Photon 2023

@PhotonCommunity
@PhotonArchive
@photonlesson

فهرست

HTF narrative and poi selection is everything! Perfect LTF entry model in wrong HTF area is worthless

مقدمه

۱. تحلیل ساختار

دو پایه تحلیل: ساختار/نواحی عرضه و تقاضا

دو مفهوم اصلی که پایه تحلیل ماست شامل ساختار قیمت و نواحی عرضـه و تقاضـا است. در واقع از طریق شناخت ساختار (روند و جهت قیمت) و نـواحی عرضه/تقاضـا می‌توانیم رفتار قیمت را بشناسیم و بر اساس آن ترید کنیم. حرکت قیمت بـر اسـاس نقدینگی که در نواحی مهم وجود دارد میسر می‌شود. این حرکت قیمت بـین نـواحی عرضه و تقاضا ساختار نسبتا منظمی را شکل می‌دهد. با درک علت حرکـت قیمـت و منطقی که به آن شکل و ساختار مشخصی می‌دهد می‌توان با حرکت قیمـت همـراه شد.

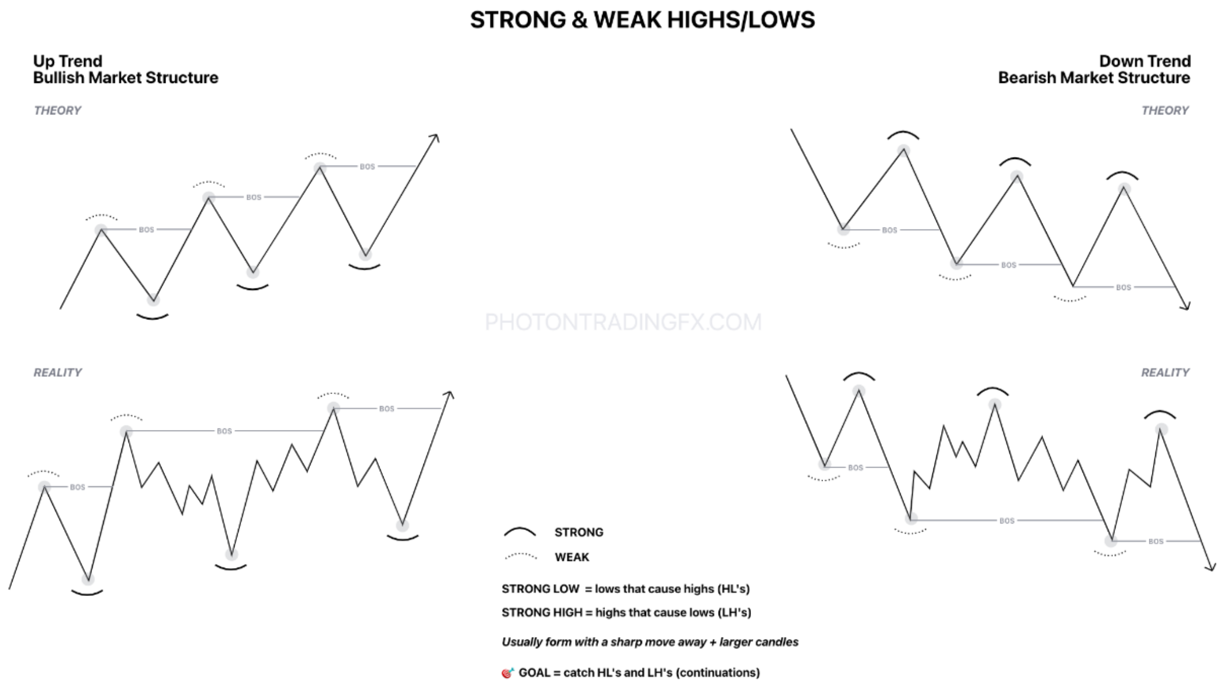
بنابراین باید بدانیم این دو مفهوم چیست؟ چطور کار می‌کند؟ و چگونه ایـن دو را در کنار هم بکار بگیریم سپس می‌توانیم بر اساس آنها تحلیل و ترید کنیم. با یـادگیری این مفهوم پایه است که بحث‌های بعدی درباره مدل‌هـای ورود و ماننـد آن بـه کـار می‌آید.

ساختار

ساختار بازار جهت جریان سفارشات بازار را نشان می دهد و چارچوبی مکانیکی برای خواندن و درک حرکت قیمت در اختیار ما قرار می‌دهد. هنگامی که ساختار بازار را به درستی درک و ترسیم کنید، می‌توانید تشخیص دهید قیمت به کجا می‌رود و چگونـه تا آنجا خواهد رفت و سناریوهای معتبری را برای حرکت قیمت ارائه کنید. اگر بتوانید در رویکرد خود برای ترسیم ساختار بازار یک روش سیستماتیک و ثابت داشته باشید، احتمال دستیابی به نتایج ثابت در یک محیط نامطمئن (بازار) ممکن می‌شود.

تشخیص ساختار به معنای تشخیص روند و جهت قیمت اسـت زیـرا انتظـار مـی‌رود قیمت تا وقتی که روند و جهت دیگری نگرفته، همان روند یا جهـت را ادامـه دهـد. دانستن این قاعده در تشخیص حرکت بعدی قیمـت کمـک مـی‌کنـد و بـه تبـع آن احتمال موفقیت در معامله را افزایش می‌دهد و در نتیجـه ریسـک معاملـه را کـاهش می‌دهد.

بنابراین مهم‌ترین مساله در تحلیل ساختار بازار، تشخیص روند است. روند و جهت قیمت بر اساس توجه به سقف/کف های بالاتر (روند صعودی) یا پایین تر (روند نزولی) شکل می‌گیرد.



https://s3.tradingview.com/snapshots/3/3HQaRZ68.png

هر سقف/کف که می‌شکند و قیمت (با بدنه کندل) از آن عبور می‌کند یک شکست ساختار یا باس (bos) شکل می‌گیرد. اگر قیمت در حال زدن کف و سقف بالاتر است و این شکست و باس رو به بالا شکل گرفته یک ساختار و روند صعودی داریم و اگر در حال زدن کف و سقف پایین‌تر است و شکست مذکور رو به پایین صورت گرفته یک ساختار و روند نزولی داریم. در تعیین ساختار و روند تایم‌فریم «معین» قیمت تنها به شکست (باس) آخر توجه می‌کنیم.

در یک روند صعودی، کف‌های بالاتر از هم، کف قوی و سقف‌ها سقف ضعیف هستند. چون هر کف باعث یک شکست ساختار شده است اما سقف‌ها بدون دستاورد هستند. در روند نزولی هم عکس این امر صادق است. معامله در جهت روند به معنای وارد شدن در کف‌های قوی و هدف قرار دادن سقف‌های ضعیف (در یک روند صعودی) است. (فصل ۶.۱ و ۶.۲)

بنابراین:

- کف/سقف قوی موجب شکست ساختار می‌شود.
- کف/سقف ضعیف قادر به شکست ساختار نیست.
- کف‌های قوی ← کف‌هایی که باعث ایجاد سقف‌های بالاتر شده (HL)
- سقف‌های قوی ← سقف‌هایی که باعث ایجاد کف‌های پایین‌تر شده (LH)
- کف/سقف‌های قوی معمولاً با مومنتوم بالاتری شکل می‌گیرند + کندل‌های بزرگ‌تر
- نفع موسسات بزرگ و بانک‌ها در حفاظت از کف/سقف‌های قوی است.
- هدف = ورود گرفتن در سطوح قوی یعنی کف‌های بالاتر (برای بای) و سقف‌های پایین‌تر (برای سل) و هدف گرفتن سطوح ضعیف یعنی سقف‌های بالاتر و کف‌های پایین‌تر = دنبال کردن روند

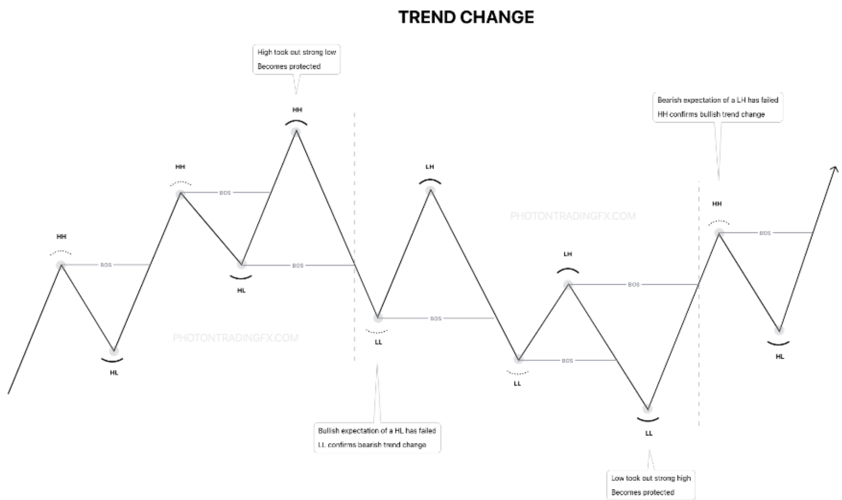
تغییر روند

هنگامی است که انتظار ما از ادامه روند با شکست مواجه شود: در یک روند صعودی، انتظار می‌رود قیمت همچنان به زدن سقف بالاتر و کف بالاتر ادامه دهد. و در یک روند نزولی، انتظار این است که قیمت همچنان به زدن سقف پایین‌تر و کف پایین‌تر ادامه دهد.

بنابراین:

تغییر روند نزولی به صعودی ← زمانی تایید می شود که قیمت یک سقف پایین‌تر را بشکند و یک سقف بالاتر را ایجاد کند (BOS صعودی).

تغییر روند صعودی به نزولی ← زمانی تایید می‌شود که قیمت یک کف بالاتر را به پایین بشکند تا یک کف پایین‌تر را ایجاد کند (BOS نزولی).



https://s3.tradingview.com/snapshots/a/adikUyRq.png

نواحی عرضه/تقاضا

فلسفه نواحی عرضه و تقاضا

(فصل ۶.۳.۱)

در اسمارت مانی به دنبال ردپای اردرهـای بـزرگ هسـتیم کـه بانـک‌هـا وارد بـازار می‌کنند تا بتوانیم با آنها همراه شویم. این اردرها ناشی از نیاز عمـده شـرکت هـا بـه ارزهای مختلف است. این شرکت ها برای رفع نیاز خود به یک ارز معین به بانک‌هـا سفارش می‌دهند و بانک ها مجبور خواهند بود برای انجام آن سـفارش‌هـا اردرهـای بزرگی رو در بازار قرار بدهند. برای محقق شدن این اردرهای بـزرگ بایـد نقـدینگی کافی در بازار باشد یعنی به همان اندازه فروشنده لازم است وگرنه عدم تعادل زیادی در قیمت ایجاد شده و موجب جهش قیمت می‌شود. در نتیجه بانـک مجبـور خواهـد شد باقی نیاز خود را با قیمت بسیار بالاتری تامین کند. بـه همـین دلیـل بانـک‌هـا و موسسات مالی بزرگ اقدام به دستکاری بازار و حرکت قیمت می‌کننـد تـا بتواننـد بـا قیمت منطقی تر ارز مورد نیاز را تامین کنند.

هر چه عمق بازار بیشتر باشد یعنی نقدینگی و تعداد خریدار و فروشـنده بیشـتر باشـد این سازوکار بهتر عمل می‌کند.

برای درک آنچه گفته شد باید توضیح دهیم چه مکانیسمی تعیین می‌کند یک چیز در بازار به چه قیمتی خرید و فروش شود و عامل شکل گیری نوسان و حرکـت قیمـت روی نمودار چیست.

یک سطح قیمتی معین از طریق ارتباط متقابل بین عرضه و تقاضا و قیمت در بزار شکل می‌گیرد. برای نمونه می‌تواند روابط زیر را بین قیمت و عرضه/تقاضا مشاهده کرد:

- هر چه قیمت افزایش پیدا کند تقاضا کمتر می‌شود
- اگر تقاضا از حد معینی کمتر شود عرضه کننده مجبور است قیمت را کاهش بدهد
- هر چه قیمت کمتر شود تقاضا بیشتر می‌شود
- هر چه قیمت کمتر شود عرضه کاهش می‌یابد چون عرضه کننده انگیزه کمتری برای عرضه دارد بنابراین ممکنه است به جایی برسیم که تقاضا از عرضه پیشی می‌گیرد
- هر چه تقاضا افزایش پیدا کند قیمت هم افزایش پیدا می‌کند
- از طرفی هر چه قیمت بیشتر شود عرضه کنندگان انگیزه بیشتری برای عرضه پیدا می‌کنند بنابراین عرضه افزایش پیدا می‌کند.

بنابراین قیمت هم روی عرضه تاثیر می‌گذارد هم روی تقاضا و و عرضه و تقاضا هم روی قیمت تاثیر می‌گذارد اینها روی یک سطح قیمت مشخص به تعادل می‌رسند که می‌شود قیمتی ک در یک لحظه معین آن کالا در بازار هم خریدار دارد و هم فروشنده دارد.

تعادل در قیمت گاه موجب می‌شود قیمت در یک سطح و رنج معین نوسان کند و کندل‌های کوچک یا بی تصمیم مثل دوجی شکل می‌گیرد. با ورود مجدد یک اردر بزرگ در صورت عدم وجود عرضه (فروشنده) به همان میزان، تعادل بهم می‌خورد و قیمت به اندازه‌ای جهش می‌کند تا به سطح قیمتی برسد که عرضه کافی وجود داشته و دوباره قیمت به تعادل برسد.

برای اینکه حالت فوق چندان مطلوب نیست و بانک‌ها می‌خواهند ارز را در قیمت‌های مناسب‌تر برای مشتریان خود تامین کنند، از تکنیک‌های پیچیده خود برای دستکاری قیمت و ایجاد نقدینگی ساختگی استفاده می‌کنند. ولی موقع این کار رد پایی از خود بجا می‌گذارند که امکان مخفی کردنش نیست. اگر این ردپاها را بشناسیم می‌توانیم دست شان را بخوانیم و با حرکت قیمت توسط بانک‌ها همراه بشویم.

برای درک شیوه دستکاری بازار باید دو نوع اردر رو بشناسیم:

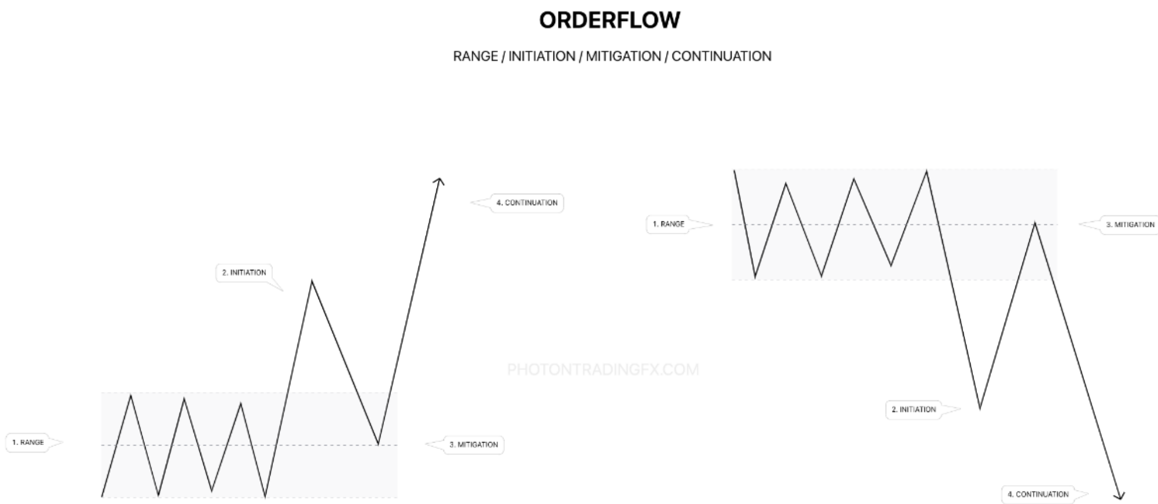
- پسیو: اردرهای کاشته شده از قبل یعنی لیمیت یا استاپ
- اگرسیو: اردرهایی که در قیمت مارکت اعمال می‌شود

اگر یک طرف امریکایی یک خرید دو میلیون یورویی در اروپا داشته باشد ینی نیاز به ۲۰ هزار لات یورو دارد بنابراین باید به یک بانک سفارش بدهد. معمولا مهلتی هم تعیین می کند برای تامین این مقدار یورو مثلا ظرف ۴۸ ساعت باید این مقدار یورو به دستش برسد. همچنین انتظار دارد این مقدار یورو با حدود قیمت امروز برایش تامین شود.

بانک می‌بیند در صورت اعمال ۲۰ هزار لات اردر خرید در یک لحظه و در قیمت مارکت (با اردر اگرسیو)، تنها بخشی از اردرهایش در سطح فعلی قیمت فعال می‌شود و وقتی نقدینگی فروشنده‌ها در آن سطح معین تمام شد قیمت جهش می‌کند تا اردرهای فروش (پسیو) سطوح بالاتر در مقابل خریدهای بانک قرار گیرد. بنابراین بخش قابل توجهی از اردرها در قیمت‌های خیلی بالاتر فعال می‌شود. به دلیل اینکه به این میزان فروشنده و نقدینگی در بازار یورو/دلار در یک سطح قیمت وجود ندارد. در این صورت یوروی مورد نیاز مشتری با قیمت مورد انتظارش تامین نخواهد شد.

برای حل این معضل بانک بخشی از اردر را به اندازه‌ای که بازار ظرفیت دارد از نوع اگرسیو (مارکت اردر) قرار می‌دهد که باعث می‌شود قیمت با مومنتوم زیاد بالا رود سپس مابقی اردرهای خودش را رو از نوعی پسیو (لیمیت) روی همون سطح قیمتی قرار می‌دهد. بنابراین با مشاهده الگوی رفتاری قیمت می‌توان رد پاش باقی مانده بانک را متوجه شد. یعنی وقتی قیمت با مومنتوم بالا از یک اردربلاک معتبر خارج می‌شود احتمال چنین سناریویی را می‌دهیم که بخشی از اردرهای بانک‌ها که پسیو هستند قرار است با برگشت قیمت به همان سطح فعال شود. بنابراین در دفعه دوم که قیمت به آن سطح قیمت برگشت به دنبال تاییدهایی می‌گردیم که بتوانیم با حرکت مجدد قیمت از آن سطح همراه شویم.

در این موارد معمولا بعد از اینکه در یک سطح خاص قیمتی تعادل نسبی بین خریدار و فروشنده وجود دارد و قیمت در حالت رنج ساید قرار دارد (range)، قیمت از یک طرف با مومنتوم بالا سقف/کف رنج را می‌شکند (initiation) سپس برای پر کردن باقی اردرها به سطح مورد نظر باز می‌گردد (mitigation) و بعد از پر شدن اردرها دوباره به حرکت خود ادامه می‌دهد (continuation):



https://s3.tradingview.com/snapshots/i/IdTxZVBR.png

اگر باز هم نقدینگی کافی نبود بانک‌ها از طریق سویپ کـردن اسـتاپ‌هـای نزدیـک ترین کف (سویپ زون‌ها) قبل از ایجاد حرکـت اصـلی در قیمـت تعـداد زیـادی اردر فروش را که همان استاپ لاس های قرار گرفته در زیر کف هـای حمـایتی هسـتندُ فعال می‌کنند. همچنین گاه بعد از برگشـت مجـدد قیمـت بـه همـان سـطح، اجـازه می‌دهند قیمت کمی از سطح مورد نظر عبور کند تا جایی کـه اسـتاپ هـای زیـر آن ناحیه زده شود و تعداد بیشتری اردر فروش فعال شود. به این روش‌ها نقدینگی کافی را برای پر شدن کامل اردرهای خرید خود فراهم کنند.

بنابراین برای یافتن نواحی عرضه تقاضا که دارای رد پای اردرهای بزرگ هستند باید این موارد رو رصد کنیم:

۱. جاهایی از نمودار که عدم تعادل در عرضه و تقاضا مشاهده می‌شود تعیین می‌کنیم

۲. سطحی که منشا ورود اردرهای بزرگ که باعث عدم تعـادل شـدن رو بـرای ورود مشخص کنیم (به ویژه سویپ زون‌ها)

۳. از تحلیل ساختار و مولتی تایم فریم برای افزایش ضریب اطمینان نسبت به نواحی انتخابی استفاده کنیم

تشخیص نواحی عرضه/تقاضا

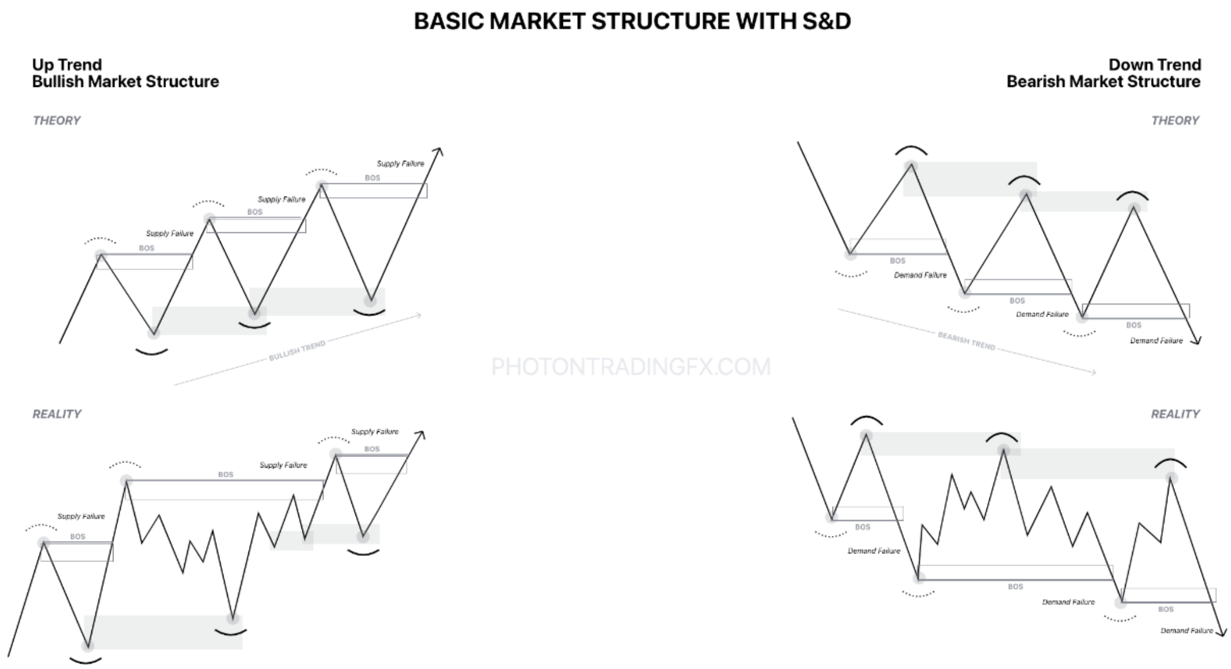
برای اینکه بدانیم حرکت ناشی از عدم تعادل از اردرهای بزرگ و قـوی ناشـی شـده است معیارهایی قرار داده شده است. مثل اینکه عدم تعادل مورد نظر باعث شکسـت ساختار شده باشد.

بنابراین مهم‌ترین عنصر در شکل گیری نواحی عرضه/تقاضا سقف و کف‌ها هستند که به سقف/کف قوی و ضعیف تقسیم می‌شوند. تریدهای ما بر اساس ورود به پوزیشن در کف/سقف های قوی و تی‌پی قرار دادن سقف/کف های ضعیف است.

اما معیار شناسایی سقف و کف‌های قوی و ضعیف چیست (فصل ۶.۱ و ۶.۲)؟

شکل گیری ساختار سقف و کف های بالاتر باعث ایجاد کف های قوی و سقف های ضعیف (و بالعکس) می‌شود.

در واقع کف قوی کفی است که موجب شکست (عبور قیمت از) یک سقف شده است و بالعکس. در شکل زیر منحنی‌های پررنگ سقف/کف‌های قوی و منحنی‌های کمرنگ سقف/کف‌هاف ضعیف هستند:

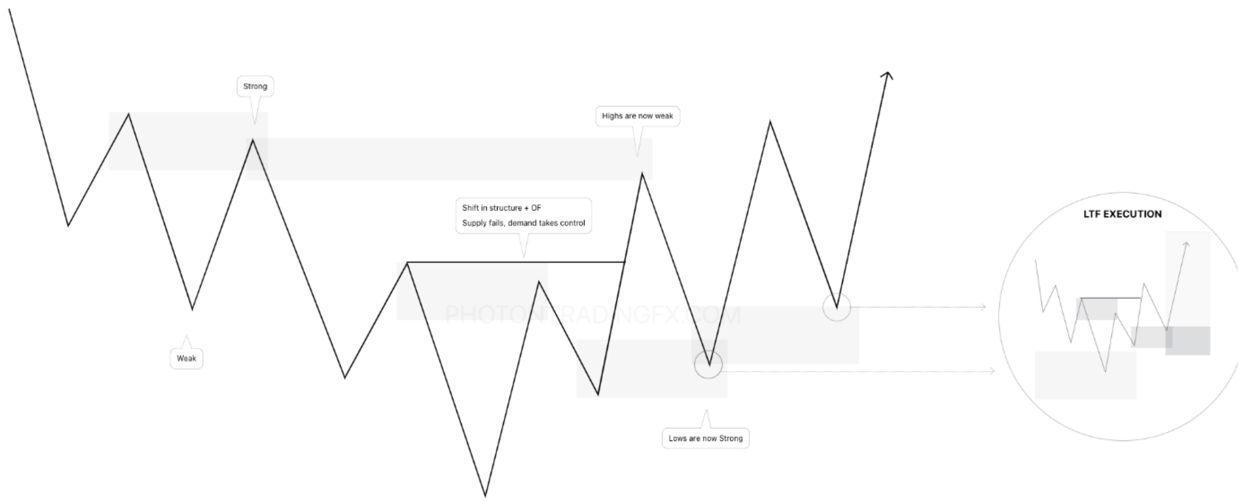


https://s3.tradingview.com/snapshots/3/3aYJAYMm.png

به دلیل اینکه انتظار می‌رود یک روند ادامه پیدا کند بنابراین انتظار داریم سقف/کف های قوی هولد شود و نشکنند. بر همین اساس، این نواحی، اگر کف قوی باشد، نواحی تقاضای قوی ما هستند و برای ورود به پوزیشن بای استفاده می‌شوند و اگر سقف قوی باشد، نواحی عرضه قوی ما محسوب می‌شود و برای ورود به پوزیشن سل مناسب است.

برای ورود در این نواحی، می‌توان از ورود بدون تایید و مستقیم استفاده کرد و می‌توان با رسیدن قیمت به آن، برای افزایش اطمینان و افزایش ریسک به ریوارد، به

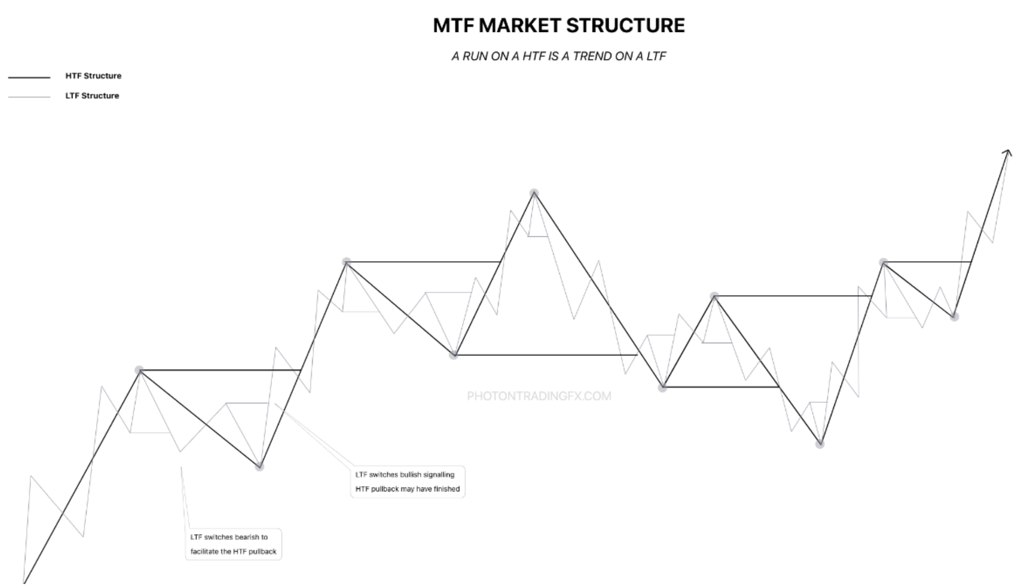
تایم ورود رفت با تایید (چاک) در تایم ورود، وارد پوزیشن شد. (چاک یا تغییر ماهیت ساختار از طریق زده شدن آخرین سقف/کف قوی در تایم پایینی است. نکات مربوط به چاک در فصل ۶.۱ گفته شده.)



https://s3.tradingview.com/snapshots/b/B2Gk5eYR.png

کار با سه تایم فریم

حرکت قیمت در تایم‌فریم پایین، حرکت قیمت در تایم‌فریم بالاتر را می‌سازد. به همین دلیل یک لگ ساده در تایم‌فریم بالاتر یک روند و ساختار در تایم فریم پایین‌تر است. پس با در نظر گرفتن چند تایم‌فریم می‌توان بهتر منطق حرکت قیمت و ساختار را درک کرد.



https://s3.tradingview.com/snapshots/k/K8Z6MNBe.png

نتیجه مطالبی که قبلا گفته شد این بود تنها یک تایم فـریم بـرای تحلیـل سـاختار داریم (مثلا ۱۵ مین) که در کف/سقف‌های قوی آن به دنبـال محـل مناسـبی بـرای ورود هستیم و در صورت نیاز به گرفتن تایید ورود یک تـایم فـریم هـم بـرای ورود (مثلا ۱ دقیقه) اضافه می‌شود.

اما باید یک تایم فریم دیگر یعنی تایم ساختار (مثلا ۴ ساعته) را هم به مدل تحلیـل خود اضافه کنیم که ساختار یا روند آن بر ساختار یا روند تایم میانی مـا مـوثر اسـت. بنابراین سه تایم‌فریم خواهیم داشت شامل تایم فریم ساختار، تـایم فـریم میـانی یـا ساختار داخلی و تایم فریم پایینی:

	سوینگ تریدر	دی تریدر	کارکرد
تایم ساختار	۴ـ۱ ساعته	روزانه	۱. تشخیص جهت کلی بازار: پرو سوینگ/کانتر سوینگ (تشخیص فاز حرکتی تایم ساختار) ۲. نواحی: یافتن نواحی که ممکنه است روند تایم میانی را تغییر دهد
تایم میانی	۱۵ دقیقه	۴ ساعته	۱. تشخیص روند جاری: پرو ترند/کانتر ترند (در نسبت با فاز تایم ساختار) ۲. نواحی اصلی برای ورود (ریسکی/با تایید) ۳. تشخیص فاز حرکتی تایم میانی
تایم داخلی میانی	۱۵ـ۵ دقیقه	۱۵ـ۱ ساعته	۱. تعیین روند جاری در نسبت با فاز حرکتی تایم میانی (فق فاز ۱و۳) ۲. تعیین نواحی ورود (ریسکی یا با تایید)
تایم پایینی	۵ـ۱ دقیقه	۱۵ دقیقه	تایید ورود در نواحی تایم ۵ـ۱۵ دقیقه

از این به بعد، فرض می‌کنیم سوینگ تریدر هستیم و ست تایم فریم را ۴ ساعته، ۱۵ دقیقه و ۵–۱ دقیقه در نظر می‌گیریم. ممکن است هر یک از این سه تـایم‌فـریم بـر اساس عمق پولبک یا سوینگ‌های اصلاحی و تعداد کندل‌هـای آن بـه انـدازه یـک تایم‌فریم بالاتر یا پایین‌تر در نظر گرفته شود.

بنابراین:

استفاده از ست مشخص تایم‌فـریم بـه روش زیـر بـرای حفـظ ثبـات در معـاملات ضروری است:

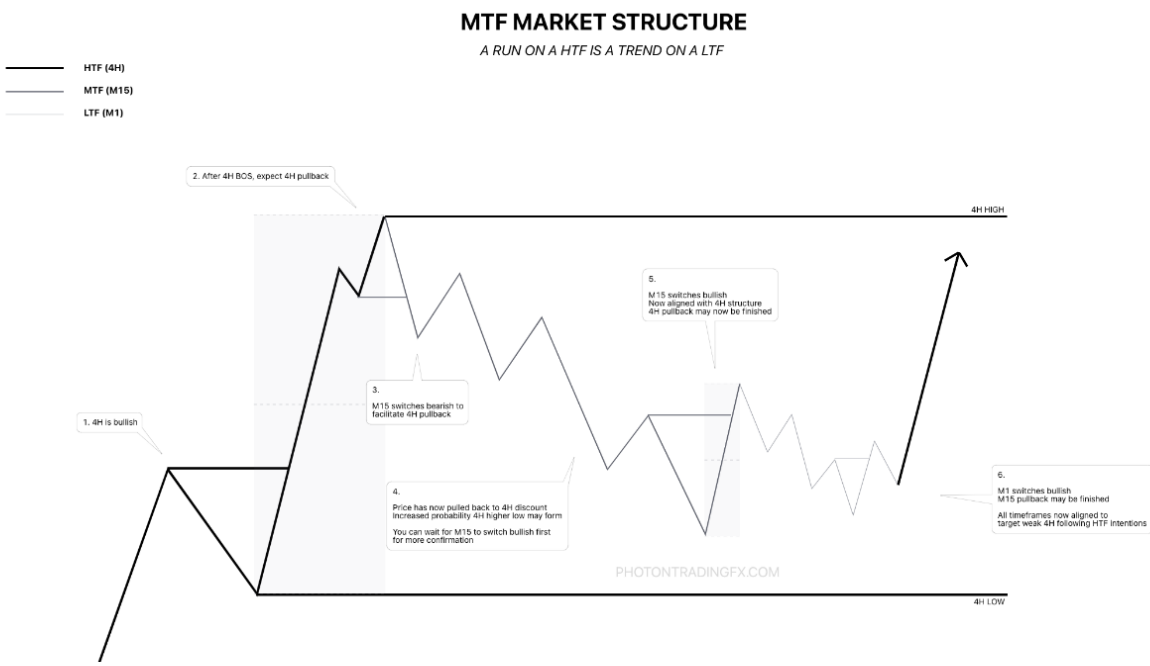
تایم فریم بالا ← داستان قیمت و فاز حرکتی: آیا در حال ترید پولبک هستیم یا سوینگ ادامه‌ی روند. از طرفی اردربلاک‌های تایم ساختار را که ممکن است پولبک روی آنها شروع شود یا در واکنش به آنها پایان یابد ترسیم می‌کنیم.

تایم فریم میانی ← وضعیت جاری: روند پولبک تایم ساختار با اولین باس خلاف روند در تایم میانی شروع می‌شود و با اولین تغییر روند (احتمالا در EQ تایم ساختار) با باس تایم میانی تمام می‌شود. نواحی اصلی عرضه/تقاضا برای ترید نواحی هستند که بر اساس باس‌های تایم میانی ایجاد می‌شوند.

تایم داخلی میانی ← ساختار تایم میانی هم مانند ساختار تایم بالا دارای ساختار داخلی است که پولبک و سوینگ آن را محقق می‌کند و مانند تایم فریم میانی می‌توان بر اساس این دو فاز روی نواحی که به دست می‌دهد ترید کرد.

تایم فریم پایینی ← اجرا: کمک می‌کند نقاط چرخش و تغییر روند در تایم میانی/داخلی میانی را پیدا کنیم و از این طریق با تایید و ریوارد بیشتر وارد پوزیشن شویم.

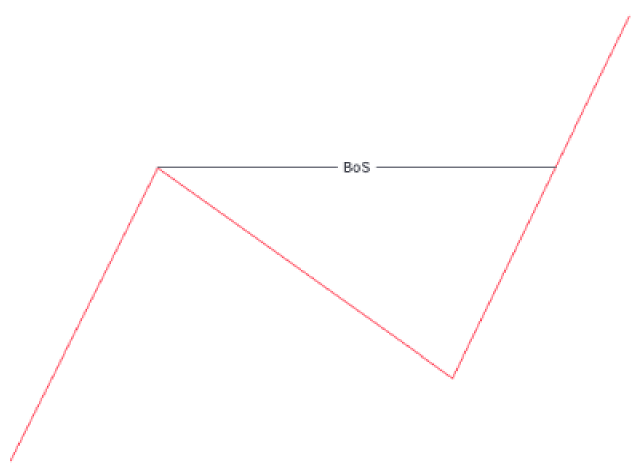
هدف ما این است که شکل گیری ساختار قیمت در اطراف نواحی مهم (POI) را مشاهده کنیم و به آنچه از طریق شکل دادن به ساختار معین به ما می‌گوید با ذهنی خنثی گوش دهیم. معیارهای شناسایی ساختارها در تایم پایین‌تر که در نواحی مهم تایم بالاتر شکل گرفته است یک چارچوب مکانیکی است که به ما کمک می کند تا بتوانیم با جریان بازار همراه شویم:



https://s3.tradingview.com/snapshots/m/MKSzxONf.png

ترسیم ساختار

مهم‌ترین عنصر در ترسیم ساختار تعیین سطح شکست ساختار یا باس (bos) است. (فصل ۶.۱) اولین کاری که برای تحلیل ساختار انجام می‌دهیم این است که اخرین شکست ساختار با بدنه یا باس را در تایم ساختار که معمولا تایم فریم ۴ ساعته است مشخص می‌کنیم. عمق باس در هر تایم‌فریم باید با عمق باس‌های متعارف در همان تایم‌فریم تناسب و هماهنگی داشته باشد.



سپس پایین ترین نقطه ای که قیمت از آنجا برای شکست ساختار حرکت کرده را (اگر روند صعودی است) به عنوان سوینگ لو و بالاترین نقطه قبل از شروع پولبک را

به عنوان سوینگ های علامت می‌زنیم. به حرکت قیمت در فاصله بین سوینگ لو تا سوینگ های، سوینگ لگ گفته می‌شود.

هدف از ترسیم ساختار در تایم ساختار این است که:

۱. جهت و روند قیمت را مشخص کنیم تا بدانیم در تایم میانی که تایم اصلی تحلیل و ترید است در کدام جهت قرار داریم.

۲. انتظار خود از حرکت قیمت را مشخص کنیم. در بخش مربوط به فازهای حرکتی به این امر به طور کامل پرداخته شده است. مثلا اگر در پولبک تایم ساختار هستیم انتظار متفاوتی از حرکت قیمت داریم نسبت به وقتی که در لگ سوینگ بعدی هستیم و... .

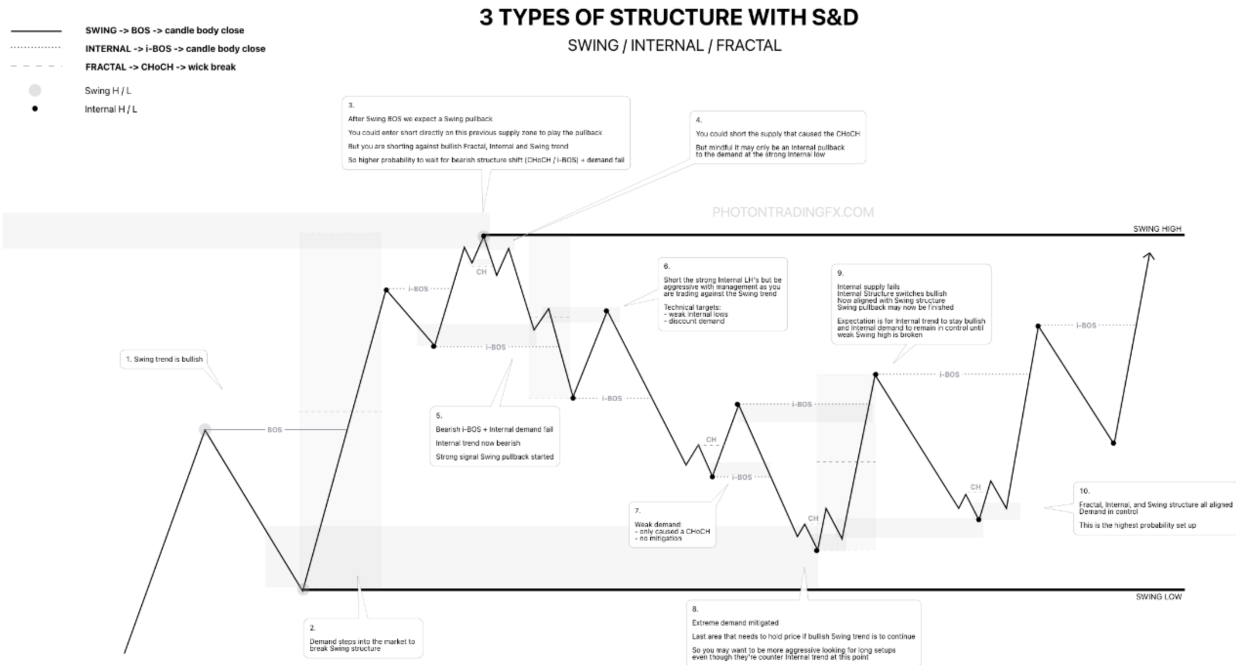
بعد از هر شکست ساختار (bos) انتظار می‌روند پولبک یا حرکت اصلاحی آن (ترجیحا بعد از واکنش به یک اردربلاک ۴ ساعته از گذشته بازار) شروع شود و قیمت حداقل تا نیمه سوینگ لگ اصلاح کند.

بنابراین:

- ساختار صعودی ← سقف‌های بالاتر (HH) و کف‌های بالاتر (HL)
- ساختار نزولی ← سقف‌های پایین‌تر (LH) و کف‌های پایین‌تر (LL)
- BOS ← شکستن ساختار در سوینگ‌ها
- کف‌های بالاتر و سقف‌ها پایین‌تر تا زمان شکست ساختار (BOS) تأیید نمی‌شوند.
- Swing High ← بالاترین نقطه‌ای که باعث سوینگ لو شده
- Swing Low ← پایین‌ترین نقطه‌ای که باعث سوینگ های شده
- پس از BOS، انتظار شروع پولبک در همان تایم‌فریم را داریم
- پولبک با اولین iBOS نزولی شروع می‌شود و با اولین iBOS تمام می‌شود.

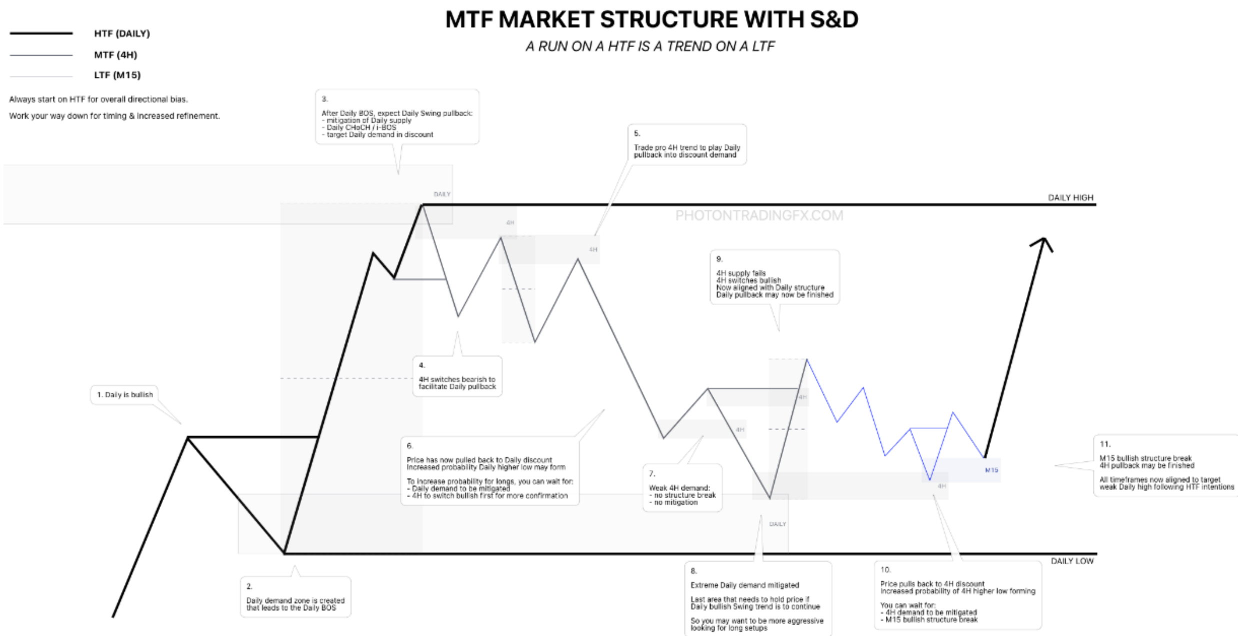
اگرچه معیار شروع پولبک زدن اولین آیباس نزولی است، اما در صورتی که قیمت به ناحیه عرضه مهمی برخورد کرده باشد، می‌توان با چاک تایم میانی هم ورود زودهنگام ولی اگرسیوتر داشت. چون هم خلاف روند سوینگ و هم اینترنال در حال ورود به پوزیشن هستیم. پس از شروع پولبک می‌توان در سقف‌های قوی ساختار داخلی وارد پوزیشن سل شد و کف‌های ضعیف ساختار داخلی را تی‌پی قرار داد.

ورود روی اردربلاک‌های تایم میانی چه در روند پولبک چه در رونـد سـوینگ بعـدی می‌تواند بدون تایید یا با تایید تایم میانی باشد:



https://s3.tradingview.com/snapshots/t/TF4F0MvM.png

اما بای کردن از کف‌های ضعیف (بعد از دیدن چاک) ساختار داخلـی ریسـکی اسـت. مگر اینکه قیمت اردربلاک مهمی از تـایم سـاختار در منطقـه دیسـکانت و ترجیحـا اکستریم آن را میتگیت کرده باشد. با زده شدن آخرین سقف قـوی سـاختار داخلـی، پولبک تمام شده و وارد سوینگ بعدی شده‌ایم. بنابراین زین پس روی کف‌های قوی بای می‌کنیم به هدف سقف‌های ضعیف. می‌توان روی این کف‌هـای قـوی از تاییـد تایم پایین استفاده کرد. زین پس که ساختار داخلی صعودی شـده نـواحی عرضـه از روند نزولی پولبک، تنها برای شروع پولبک‌های تایم میانی استفاده می‌شوند:



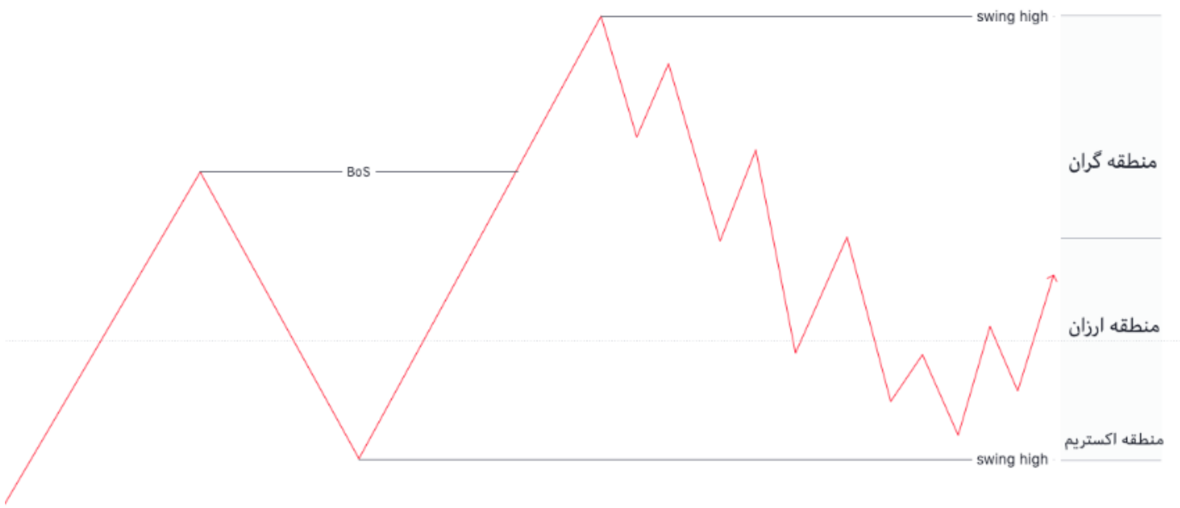
https://s3.tradingview.com/snapshots/x/XiykWg32.png

منطقه ارزان/گران

در هر بازاری اکثر معامله‌گران تلاش می‌کنند در قیمت‌های ارزان بخرند و در قیمت‌های گران بفروشند. این تلاش معامله‌گران در برایند کلی قیمت‌گذاری کالا اثرگذار بوده و موجب می‌شود قیمت در یک دوره معین از قیمت معین پایین‌تر و از قیمت مشخصی بالاتر نرود. این امر درباره ارزها هم صادق است.

در یک ساختار صعودی، نیمه پایینی هر سوینگ منطقه ارزان (discount) و مناسب پوزیشن بای و در یک ساختار نزولی نیمه بالایی سوینگ منطقه گران (premium) و مناسب پوزیشن سل است. اگر ساختار صعودی بود به پایین‌ترین سطح هم که مطمئن‌ترین سطح برای بای هست «اکستریم» گفته می‌شود در ساختار نزولی هم عکس این صادق هست.

اگر تنها بخشی از اردربلاک خارج از منطقه دیسکانت باشد می‌توان با تسامح همه آن را در منطقه دیسکانت دانست.



بنابراین برای ترسیم منطقه ارزان و گران:

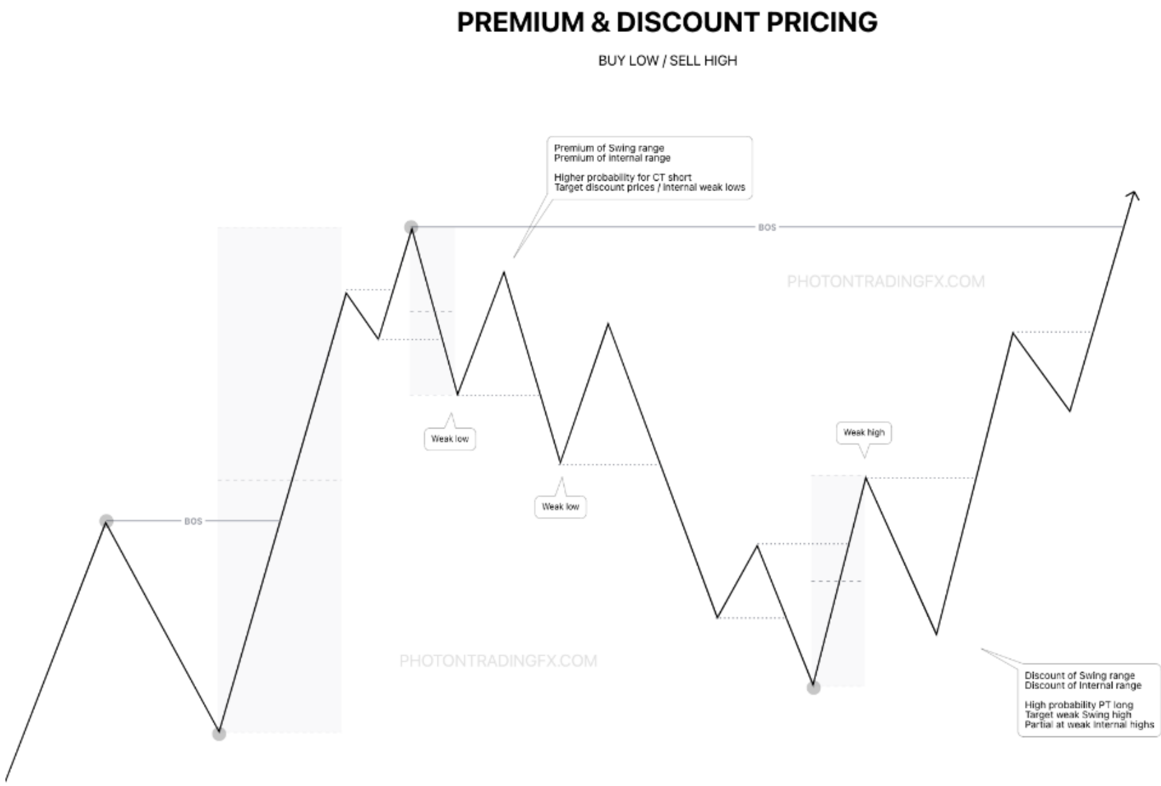
۱) ابتدا محدوده لگ سوینگی که در یک تایم‌فریم معین شکل گرفته است را از سوینگ لو تا های مشخص کنید.

۲) از ابزار فیبوناچی برای تعیین سطح تعادل استفاده کنید (۵۰٪)

۳) در ساختار صعودی، بهتر است قبل از بای منتظر بمانید تا قیمت به منطقه دیسکانت برسد و در ساختار نزولی بهتر است قبل از سل منتظر بمانید تا قیمت به منطقه پرمیوم برسد.

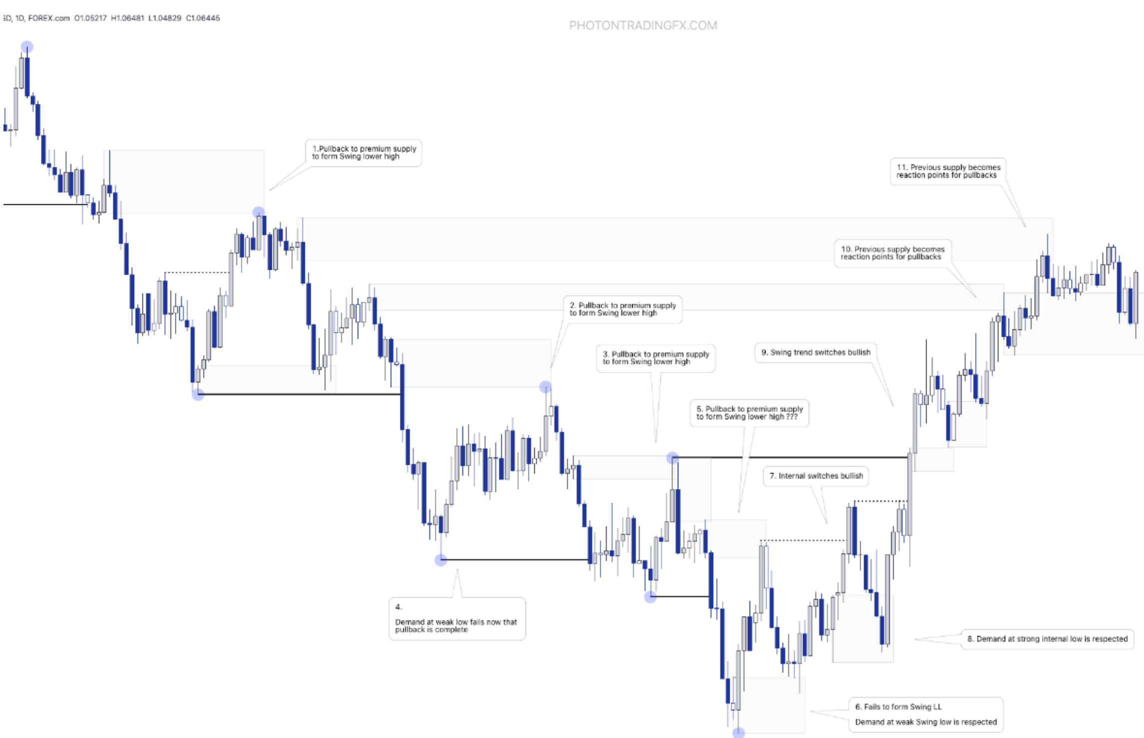
باید توجه داشت قاعده‌ای که گفته شد تنها برای کاهش ریسک ورود به معامله است و ضرورتی ندارد قیمت همیشه در یک روند صعودی تا منطقه دیسکانت اصلاح کند و یا در روند نزولی تا منطقه پرمیوم اصلاح کند. به ویژه هنگامی که مومنتوم سوینگ زیاد باشد انتظار می‌رود اصلاح کم عمق‌تری داشته باشیم.

سوینگ‌های ساختار داخلی هم که پولبک را شکل داده در تایم‌فریم خودش دارای منطقه دیسکانت و پرمیوم است و موقع ورود به آن توجه می‌شود. آن سوینگ هم اگر ساختار داخلی دارد به همین صورت عمل می‌شود:



https://s3.tradingview.com/snapshots/a/A96skCVo.png

تطبیق روی نمودار:



https://s3.tradingview.com/snapshots/w/WBLJwYVu.png

ساختار سه‌لایه

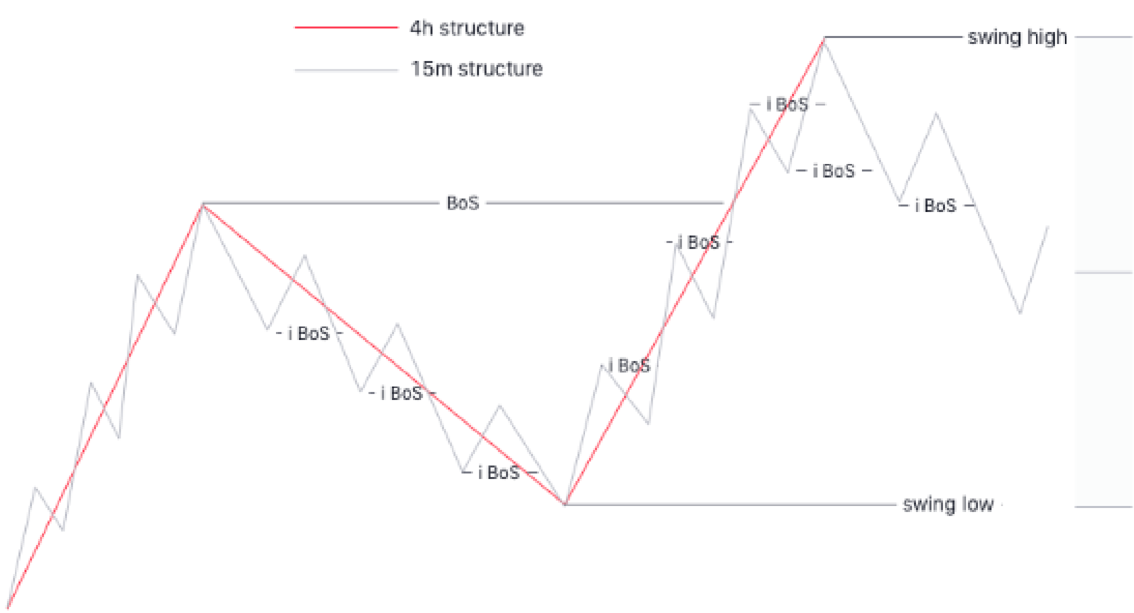
به ازای ست سه تایم‌فریمی که با آن کار می‌کنیم طبیعتا سه نوع ساختار هـم بـرای تحلیل خواهیم داشت:

ساختار سوینگ ← ساختار تایم بالا را شکل می‌دهد و شکست ساختارها در آن با بدنه اعتبار دارد.

ساختار داخلی ← به معنای ساختار تایم میانی که پولبک و سوینگ تایم بـالا را شکل می‌دهد. شکست ساختارها در آن با بدنه اعتبار دارد.

ساختار فرکتال ← معمولا در ترسیم چاک استفاده می‌شود و شکست با سایه در آن کافی است. چاک اولین نشانه ریسکی تغییر روند اسـت و مـی‌توانـد در تـایم میانی یا پایینی استفاده شود. (معیار معتبر برای تغییر روند همان شکست های/لو سوینگ است که قبلا گفته شد)

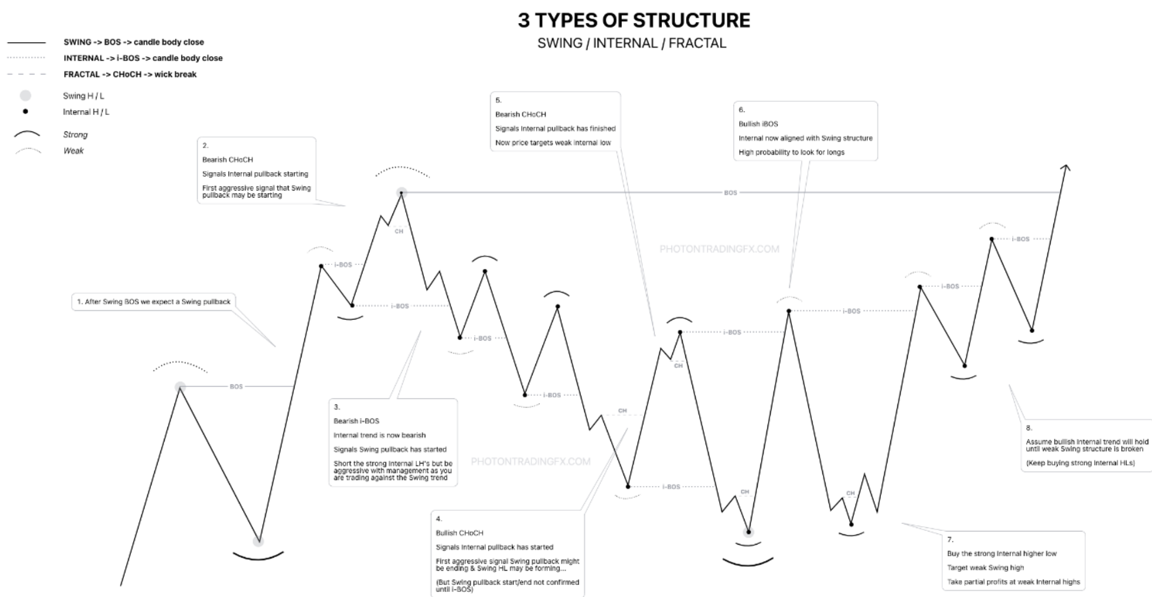
حرکت قیمت برای شکل گیری پولبک و حرکت قیمت برای شکل گیـری سـوینگ لگ بعدی (پس از پایان پولبک) در تایم فریم میانی (۱۵ مین) باس هـایی را شـکل می‌دهد که به آن اینترنال باس (ibos) گفته می‌شود. هـدف سـاختار داخلـی شـکل دادن به روند سوینگ لگ و سپس شکل دادن به روند سوینگ پولبک تـایم سـاختار است.



تحلیل ساختار با ترکیب تعیین جایگاه قیمت در ساختار اصلی (۴ اچ) و ساختار داخلی (۱۵ مین) شکل می‌گیرد. در شکل بالا بعد از آی‌باس‌هایی که سوینگ لـگ ۴ سـاعته

را شکل داده‌اند یک شکست ساختار یا باس ۴ ساعته شکل گرفته و سپس قیمت در تایم میانی (۱۵ دقیقه) نزولی شده (آیباس‌های نزولی زده) تا پولبک اصلاحی را شکل دهد. هنگامی می‌گوییم پولبک تمام شده که ساختار داخلی در منطقه دیسکانت یا اکستریم با زدن یک آیباس صعودی تغییر روند دهد و ساختار ۱۵ مین برای شکل دادن به سوینگ لگ بعدی صعودی شود.

همچنین چاک‌های تایم میانی (۱۵ مین) نشانه شروع و پایان پولبک‌های ساختار داخلی هستند. [می‌توان از ساختار داخلی میانی (iibos) هم به عنوان معیار شروع و پایان پولبک‌های تایم میانی استفاده کرد]



https://s3.tradingview.com/snapshots/6/6pt6pGMT.png

انتظار از حرکت قیمت:

۱. اولین آیباس برعکس بعد از باس: نشان دهنده شروع پولبک تایم ساختار است و انتظار می‌رود قیمت دست کم تا منطقه EQ (دیسکانت/پرمیوم) برود.

۲. هر گاه ساختار سوینگ صعودی است و پولبک آن تمام شده و بالطبع ساختار داخلی هم صعودی شده، انتظار این است که روند داخلی صعودی تا زمانی که سقف ضعیف را بزند ادامه یابد. (و بالعکس آن در روند نزولی هم صادق است)

۳. اگر ساختار داخلی صعودی نتواند این کار را انجام دهد و قبل از شکست سقف نزولی شود، انتظار این است که روند داخلی جدید تا زمانی که دوباره صعودی شود [و

احتمالا یک رنج ساید را شکل دهد] یا سوینگ لو را که هم‌اکنون مشخص شده یک کف ضعیف است بشکند، نزولی باقی بماند.

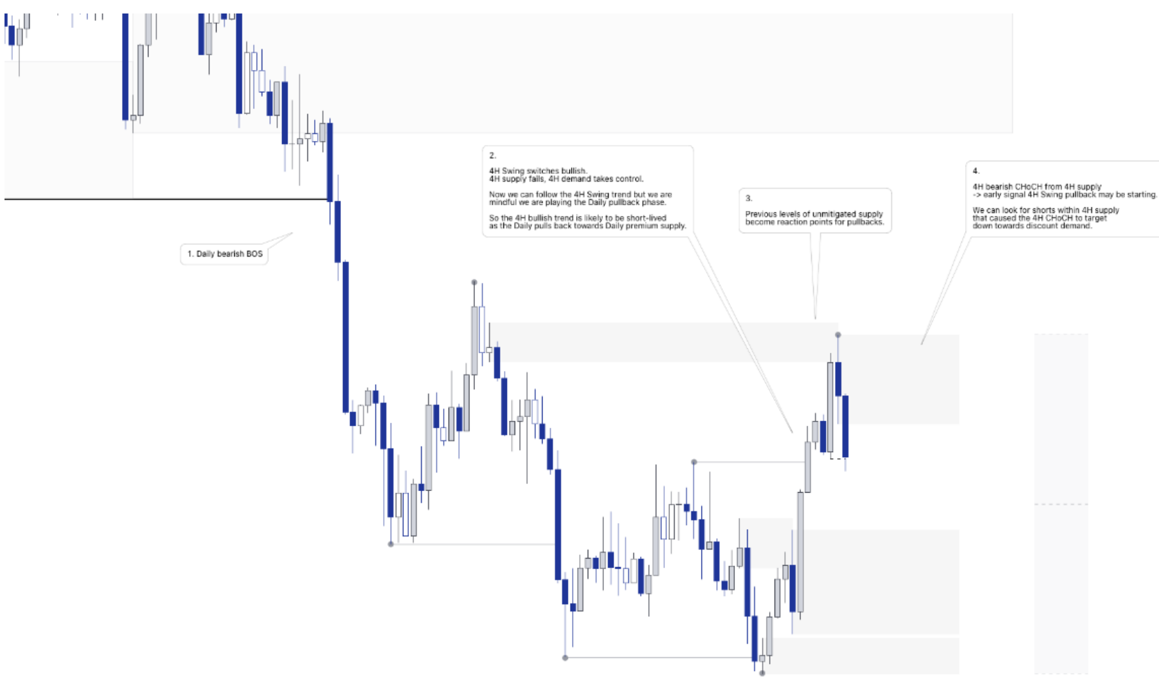
تطبیق بر نمودار

1) Daily



https://s3.tradingview.com/snapshots/8/89ILXBbI.png

2) 4H



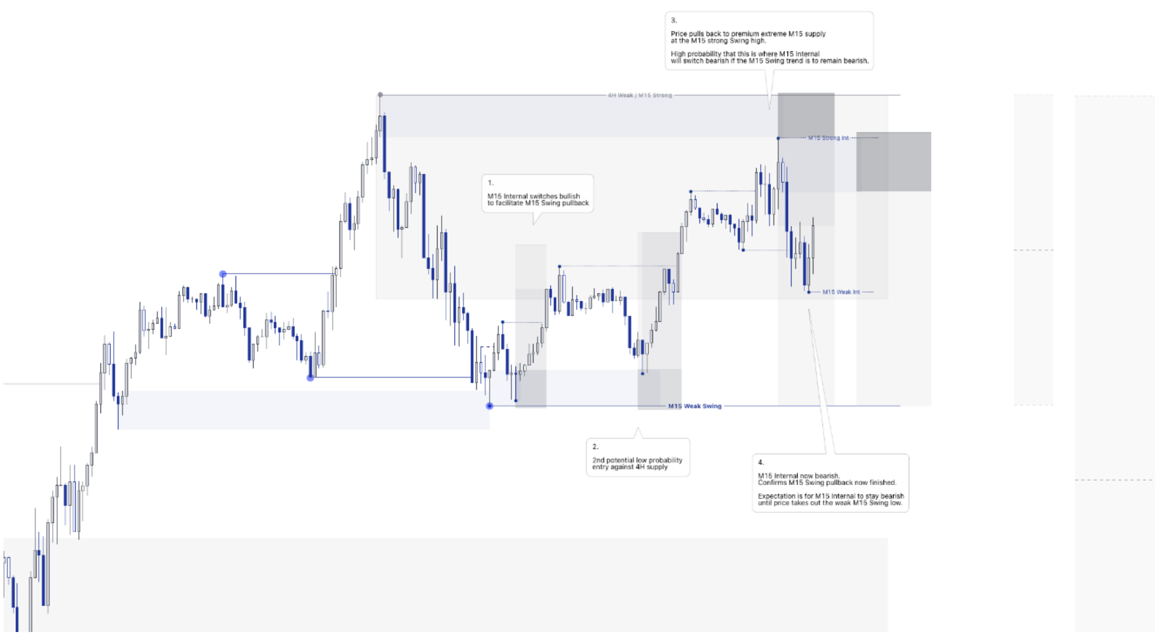
https://s3.tradingview.com/snapshots/i/iA0p58Yv.png

3) M15



https://s3.tradingview.com/snapshots/4/4SNylxjC.png

4) M15



https://s3.tradingview.com/snapshots/p/PckIlTyG.png

5) M15



https://s3.tradingview.com/snapshots/m/m0UF8lEz.png

6) M15



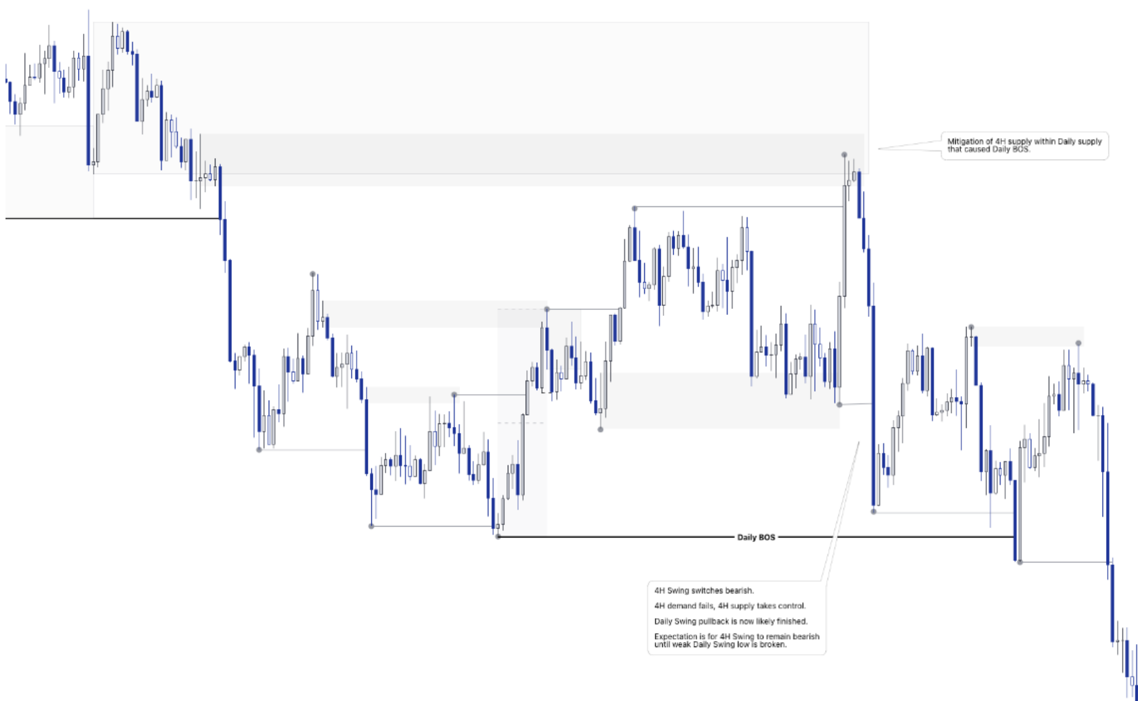
https://s3.tradingview.com/snapshots/b/BqUapbNU.png

7) M15



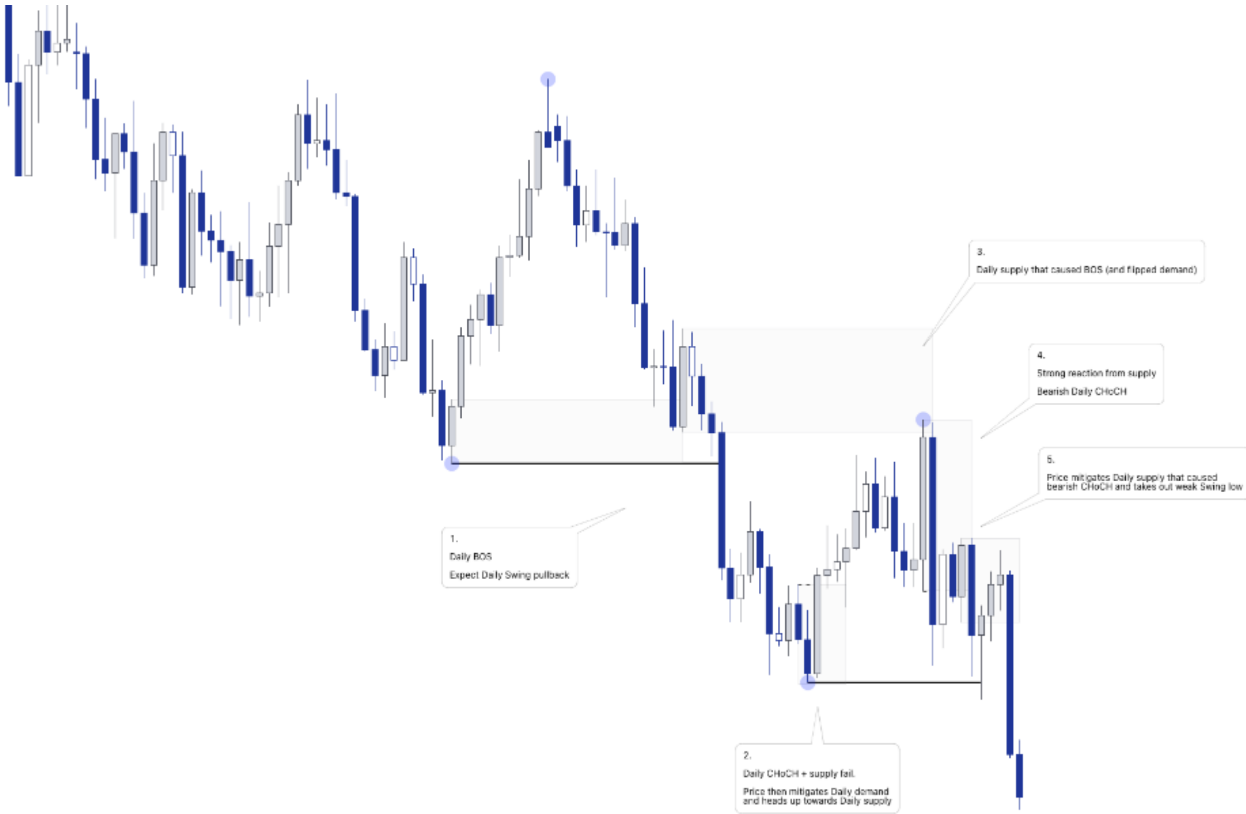
https://s3.tradingview.com/snapshots/w/WY7xXgxc.png

8) 4H



https://s3.tradingview.com/snapshots/u/uianu6Oy.png

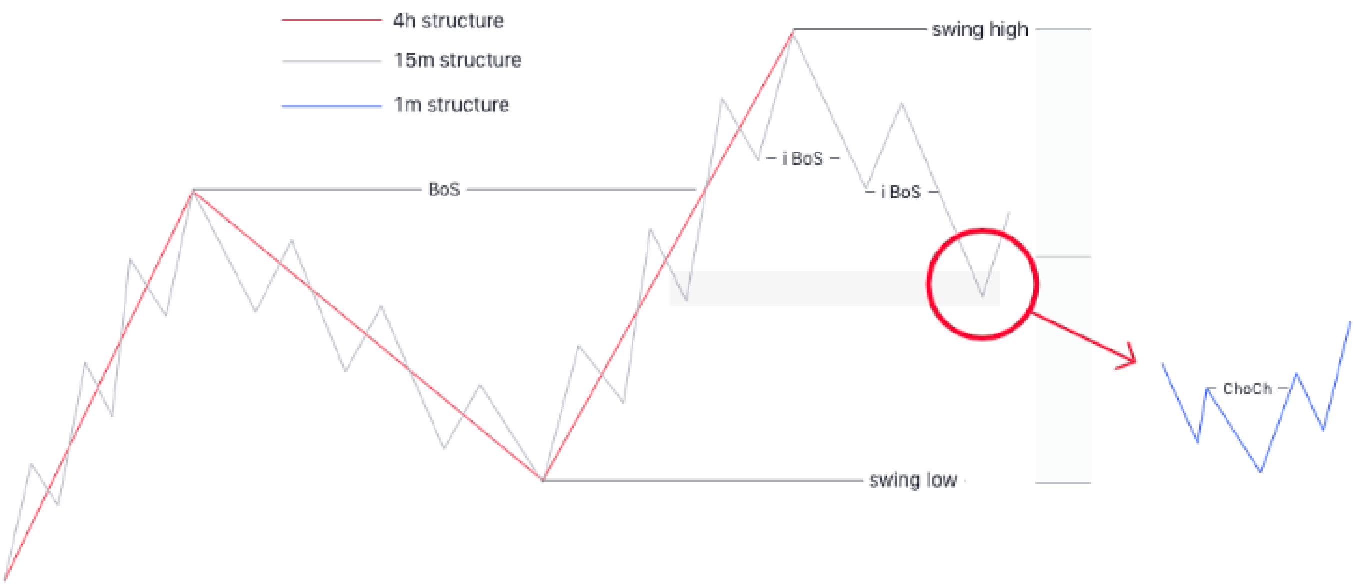
9) DAILY



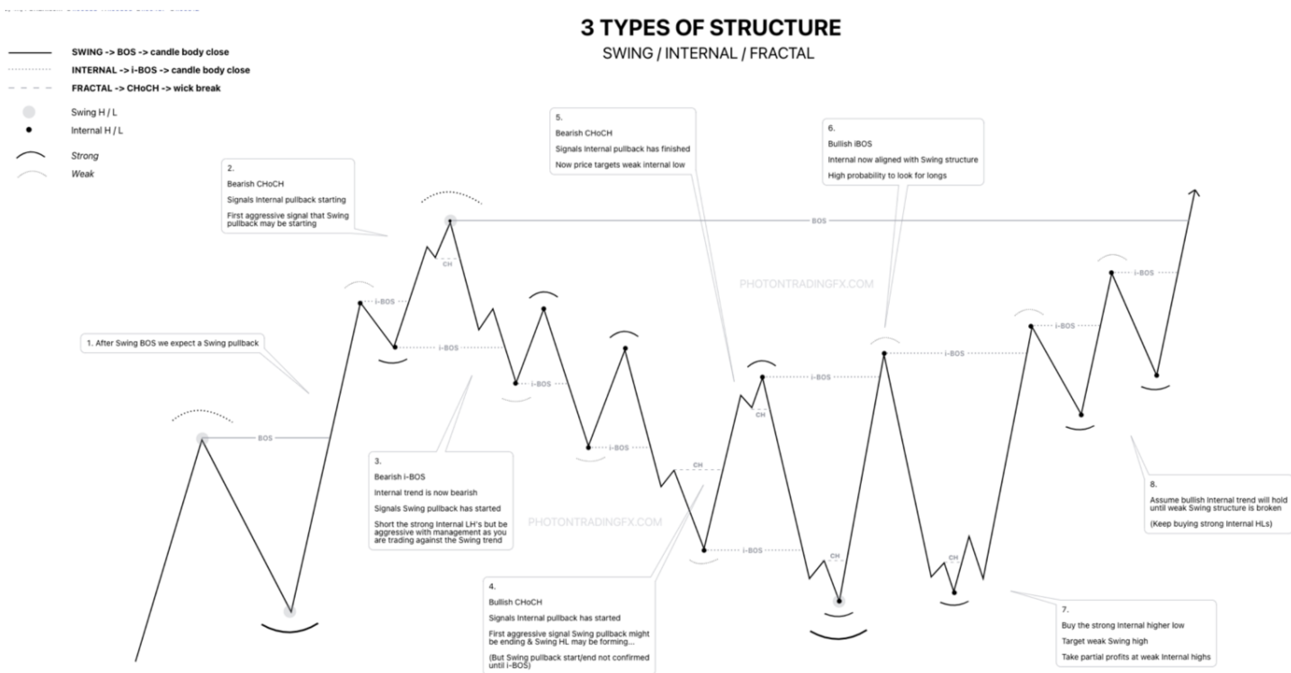
https://s3.tradingview.com/snapshots/d/dP8LA1lg.png

تایید تایم پایینی

تایم پایینی تنها در مواقع نیاز بـه گـرفتن تاییـد ورود (چاک+مـدل‌هـای ورود) روی نواحی تایم میانی استفاده می‌شود. این کار هم باعث اطمینان بیشتر با گـرفتن تاییـد می‌شود و هم برای کاستن از اندازه استاپ لاس و بالا بردن ریسک به ریوارد. حتـی در مواقعی که قیمت به یک ناحیه ۴ ساعته برخورد کرده و انتظـار شـروع پولبـک را داریم اگر قیمت به ناحیه ریفاین شده ۱۵ دقیقه ای داخل اردربلاک ۴ ساعته رسـیده باشد می‌توان مستقیم به تایم ورود (۵ـ۱ دقیقه) رفت و برای ورود تایید گرفت اگرچه این کار ریسکی است.



در شماتیک زیر روند شکل گیری ساختار و چگونگی تحلیل بر اساس آن در سه تایم فریم بالایی، میانی و پایینی توضیح داده شده است:



https://s3.tradingview.com/snapshots/6/6pt6pGMT.png

ترجمه حاشیه‌های تصویر:

۱. بعد از شکست ساختار (باس) انتظار شروع پولبک را داریم.

۲. شکل گیری چاک نزولی در تایم ۱۵ مین اولین نشانه شروع پولبک ۴ ساعته است. اگرچه این یک نشانه اولیه و اگرسیو (ریسکی) است [و تغییر روند هنگامی است که آخرین کف ساختار داخلی بشکند.]

۳. شکل گیری اولین اینترنال باس نشانه ی اصلی شروع پولبک است. از این به بعد ساختار داخلی (۱۵ مین) نزولی شده و می‌توان در سقف‌های قوی ساختار داخلی به فکر پوزیشن سل بود. فق در مدیریت پوزیشن محتاطانه رفتار کنید چون خلاف روند سوینگ اصلی (۴ اچ) ترید می‌کنید.

۴. هر چاک صعودی در مسیر نزولی ساختار داخلی نشانه ی شروع پولبک ساختار داخلی برای بردن قیمت به سمت اخرین سقف قوی ساختار داخلی است.

این چاک صعودی (اگر روی یک اردربلاک ۴ ساعته صعودی در منطقه ارزان یا اکستریم سوینگ تایم ساختار باشد) می‌تواند اولین نشانه ی اگرسیو برای پایان پولبک سوینگ اصلی باشد. این امر تنها با مشاهده اولین اینترنال باس صعودی تایید می‌شود.

۵. چاک نزولی نشانه ی تمام شدن پولبک ساختار داخلی است. انتظار می‌رود قیمت آخرین کف ضعیف ساختار داخلی را هدف قرار دهد.

۶. اولین اینترنال باس (ibos) صعودی نشان می‌دهد که احتمالا پولبک تمام شده و روند داخلی صعودی شده است. چون ساختار داخلی و ساختار اصلی هر دو صعودی شده‌اند پوزیشن بای احتمال موفقیت بالایی دارد.

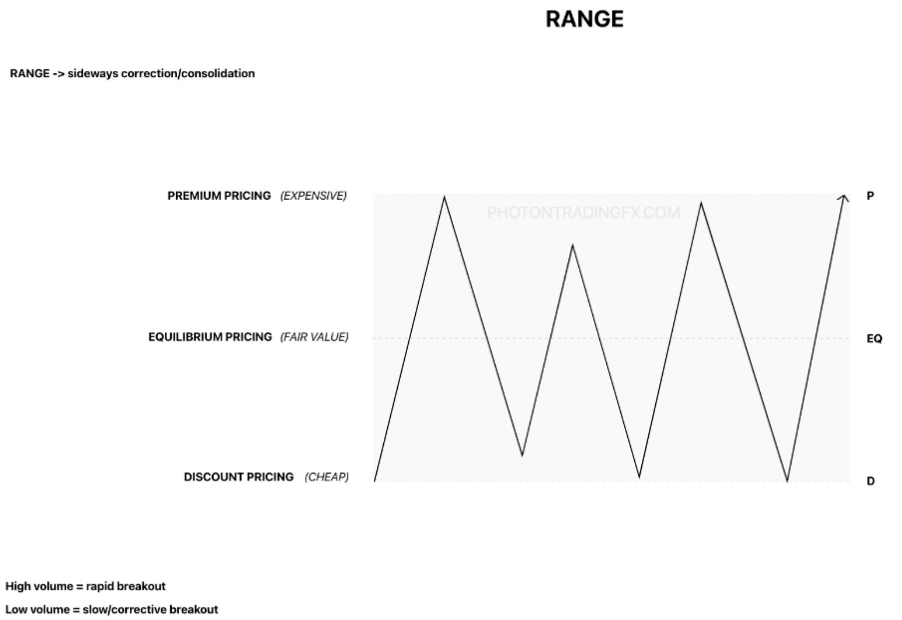
۷. محل ورود به پوزیشن‌های بای: کف‌های قوی ساختار داخلی. تی‌پی: سقف ضعیف تایم ساختار (۴ اچ)

۸. انتظار می‌رود ساختار داخلی صعودی بماند تا وقتی که قیمت از آخرین سقف ضعیف تایم ساختار (۴ اچ) عبور کند و پولبک بعدی تایم ساختار شروع شود.

اردربلاک

اکثر فعالیت‌های بانک‌ها و موسسات در بازار فارکس فقط شامل معاملات و اردرهای تجاری است که اغلب با الگوریتم‌های پیچیده در بازار انجام می‌شوند. ما با استفاده از نمودارهای کندل استیک و تایم‌فریم‌ها، می‌توانیم ردپای آن روابط پیچیده بین سفارشات بزرگ را درک کنیم.

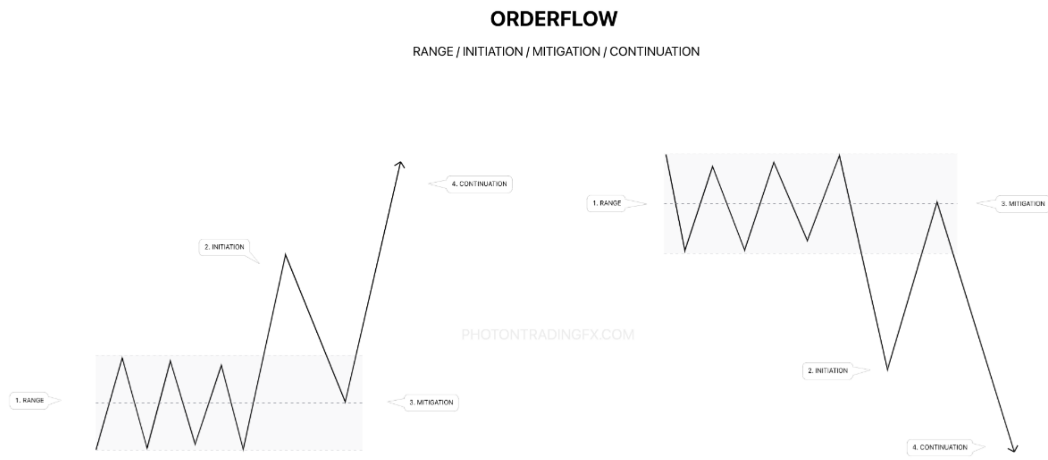
وقتی قیمت در تایم فریم مشخص در بین دو سطح قیمتی به طور مکرر حرکت می‌کند یک ناحیه رنج ایجاد می‌شود که نشان می‌دهد بین خریدار و فروشنده توازن وجود دارد و هیچ کدام کنترل را در دست ندارند. معمولا بانک‌ها و موسسات بزرگ در نواحی رنج به دنبال جذب سفارشات زیاد در یک قیمت متعادل هستند.



https://s3.tradingview.com/snapshots/0/0lSoZMic.png

هنگامی که سفارشات از اندازه معینی بیشتر می‌شود، قیمت از این ناحیه رنج خارج می‌شود و تعادل مذکور بر هم می‌خورد. گاه شکست کف/سقف رنج با شتاب و مومنتوم زیاد همراه است که دلیل این امر ورود حجم زیاد سفارشات موسسات و بانک‌ها است. چون حرکت قیمت در بازاری مثل فارکس نیاز به حجم بسیار زیاد نقدینگی دارد و تنها از عهده موسسات و بانک‌ها بر می‌آید.

بعد از اینکه چنین عدم تعادلی بین عرضه و تقاضا شکل می‌گیرد و رد پای خریدهای عمده بانک‌ها نمایان می‌شود می‌توانیم برای ورود به پوزیشن از آن ایده بگیریم. در این صورت، منتظر می‌شویم تا قیمت مجددا به ناحیه رنج برگردد تا بتواند سفارشات جا مانده را هم پر کند و مجدد به حرکت خود ادامه دهد. وقتی قیمت به ناحیه رنج رسید می‌توانیم وارد پوزیشن شویم. در واقع این رنج ناحیه عرضه/تقاضایی است که مناسب ورود است:



https://s3.tradingview.com/snapshots/i/IdTxZVBR.png

ترجیحا به دنبال شرایطی هستیم که شکست یک محدوده رنج با حجم و مومنتوم نسبتا بالا رخ دهد، زیرا این امر عدم تعادل واضح بین عرضه و تقاضا را می‌رساند که از نشانه‌های فعالیت و علاقه بانک‌ها و موسسات بزرگ در آن ناحیه است.

شکل‌گیری مناطق عرضه/تقاضا ناشی از همین عدم تعادل شدید بین عرضه و تقاضا در اثر فعالیت پرحجم بانک‌ها و موسسات است. بنابراین می‌توانیم با دیدن عدم تعادل در جایی که قیمت از یک محدوده خارج شده است، آنها را شناسایی کرده و روی نمودار ترسیم کنیم. (کل ناحیه رنج یا ریفاین پیووتی آن) ما بر خلاف برخی سبک‌ها شکست اولیه را معامله نمی‌کنیم، در عوض منتظر می مانیم تا قیمت جهت خود را کاملا نشان دهد و ببینیم می خواهد به کدام سمت برود. بعد منتظر می‌مانیم تا قیمت به آن ناحیه بازگردد و سپس به دنبال تاییدها و ستاپ‌های ورود می‌رویم.

چنین ناحیه عرضه/تقاضایی به دو صورت ممکن است برای ترید در نظر گرفت:

۱. کل ناحیه‌ای که قیمت با زدن چندین کندل نزدیک بهم بین دو سطح قیمت بالا و پایین رفته بگیریم چه به صورت ساید باشد یا کمی جهت دار باشد.
۲. آخرین تلاش قیمت برای حرکت در جهت مخالف را اردربلاک بدانیم.

در حالت دوم می‌توان آخرین کندلی که در نوک یا قسمت پیووت ناحیه رنج تشکیل شده هم در نظر بگیریم. حالت دوم می‌تواند ریفاین شده ی حالت اول باشد. یعنی آخرین کندلی که قیمت در آن از بی تصمیمی خارج شده و حرکت پرشتاب و

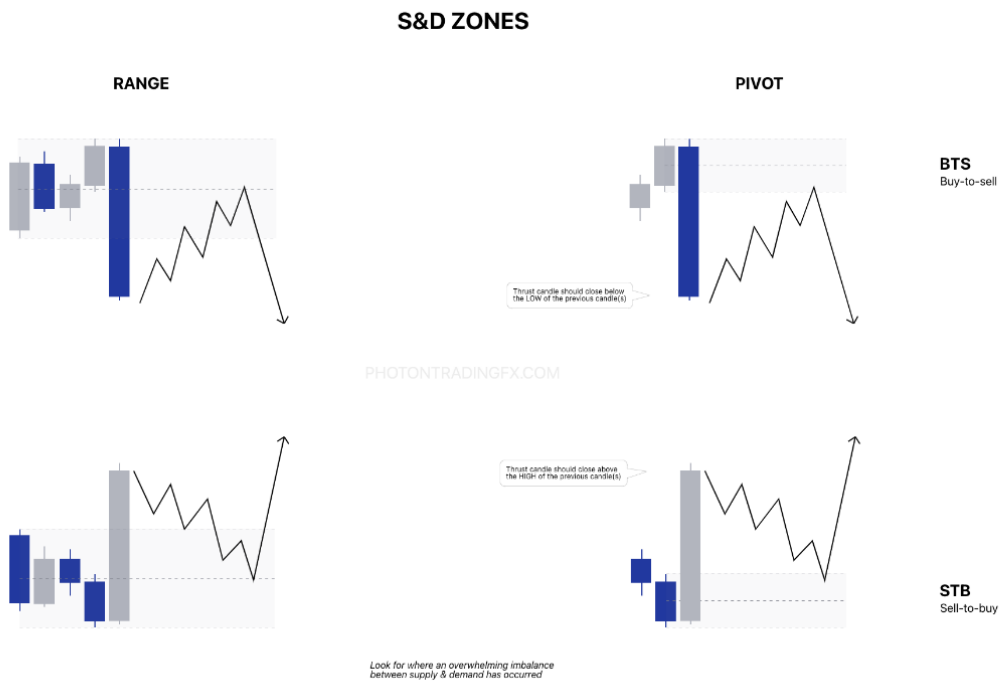
مومنتوم دار را شروع کرده است. همچنین ممکن است آخرین موج سل تو بـای (یـا بالعکس) را در نظر بگیریم.

* به ناحیه رنج یا آخرین «حرکت در جهت خلاف» که پس از آن قیمت تصمیم بـه حرکت اصلی خود گرفته ناحیه بای تو سل (bts) یا سل تو بای (stb) گفته می‌شود.

در ترسیم یک ناحیه دیمند، اگر کندل آخری که در کف زده شده نزولی بود می‌تـوان همان کندل را به عنوان آخرین ناحیه سل تو بای در نظر گرفت ولی اگر صعودی بود کندل نزولی قبل از آن را هم اضافه می‌کنیم. مخصوصا اگر کندلی کـه از اردربـلاک خارج شده (کندل انگالف) بالای هر دو کلوز داده روش دوم ترجیح دارد:



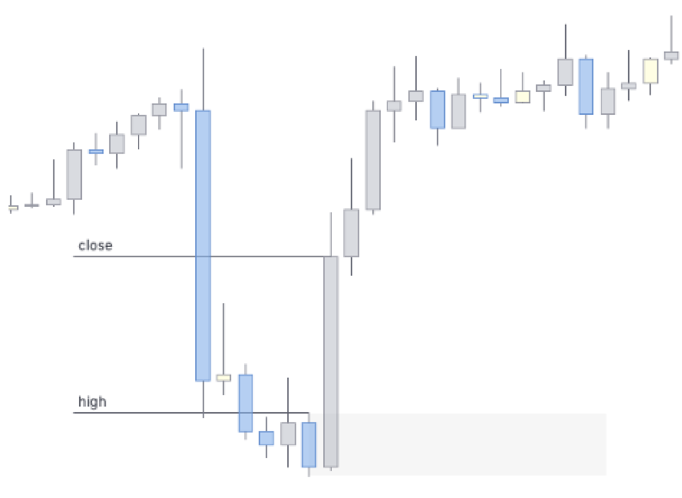
اگر از های تا لوی ناحیه ترسیم شده را در نظر بگیریم و در یک باکس ترسیم کنـیم به آن اردربلاک گفته می‌شود. چون ناحیه‌ای را به دست می‌دهـد کـه انتظـار داریـم اردرهایی در آن باقی مانده باشد که با برگشت قیمت به آن قرار است دوبـاره باعـث حرکت قیمت شود:



https://s3.tradingview.com/snapshots/q/QrWbsVTQ.png

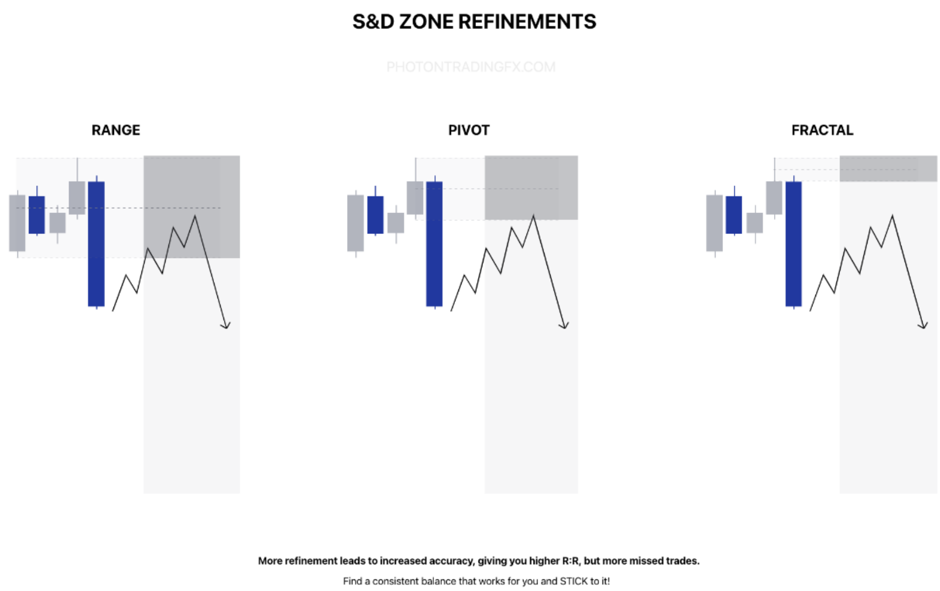
نکته: در شماتیک فوق و موردی که اردربلاک رنج ترسیم شده، مت معمولا به جـای کل ناحیه رنج آخرین حرکت بای تو سل را به عنوان اردربلاک ترسیم می‌کند که در تصویر بالا شامل کندل سوم و چهارم می‌شود.

دقت کنید که کندلی که با مومنتـوم از اردربـلاک خـارج شـده بایـد جـایی خـارج از اردربلاک کلوز کرده باشد (انگالف) و بهتر است با فاصلـه قابـل تـوجهی از آن کلـوز کرده باشد تا بتوان از آن نشان‌دهنده ورود پول قابل توجه به بازار و در کنترل گرفتن جهت بازار باشد:



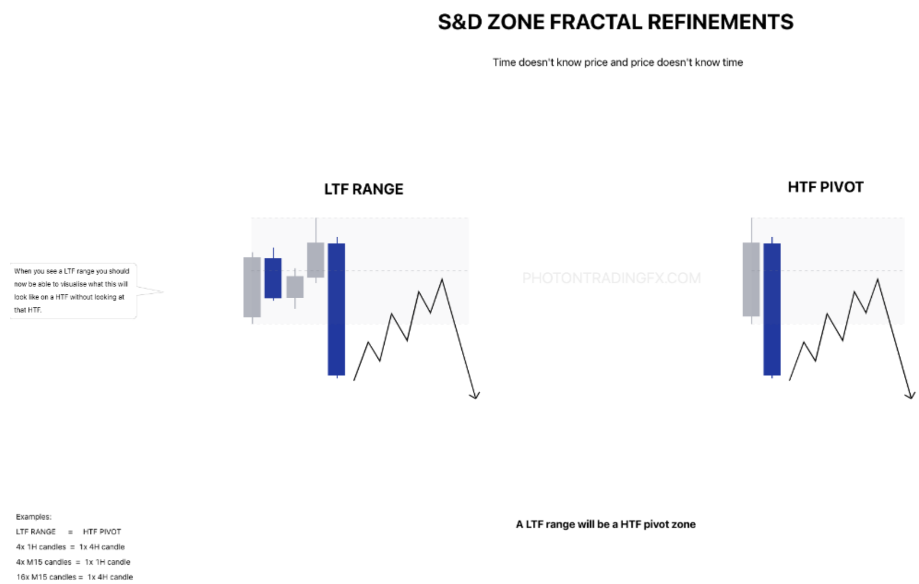
همچنین بهتر است بعد از خروج از اردربلاک یک سایه قابل توجه در جهت عکس نزده باشد چون چنین سایه‌ای نشان می‌دهد که قیمت ابتدا با سرعت خارج شده ولی بعد بخاطر فشار فروش/خرید در جهت مقابل، با سرعت ریجکت شده و مومنتوم مورد نظر را نداشته است.

در صورتی که به دلیل اینکه ریوارد بهتری بگیرید نیاز به ریفاین بیشتر داشتید می‌توان اردربلاک را در سایه کندل اردربلاک هم قرار داد. مخصوصا وقتی که کندل اردربلاک بزرگ باشد یا سایه بلندی داشته باشد. مهم این است که همیشه بر اساس یک قاعده عمل کنید:



https://s3.tradingview.com/snapshots/7/7wZuPbc6.png

همیشه یک ناحیه رنج در تایم فریم پایین‌تر، یک ناحیه یا اردربلاک پیووتی در تایم فریم بالاتر را می‌سازد و برعکس:

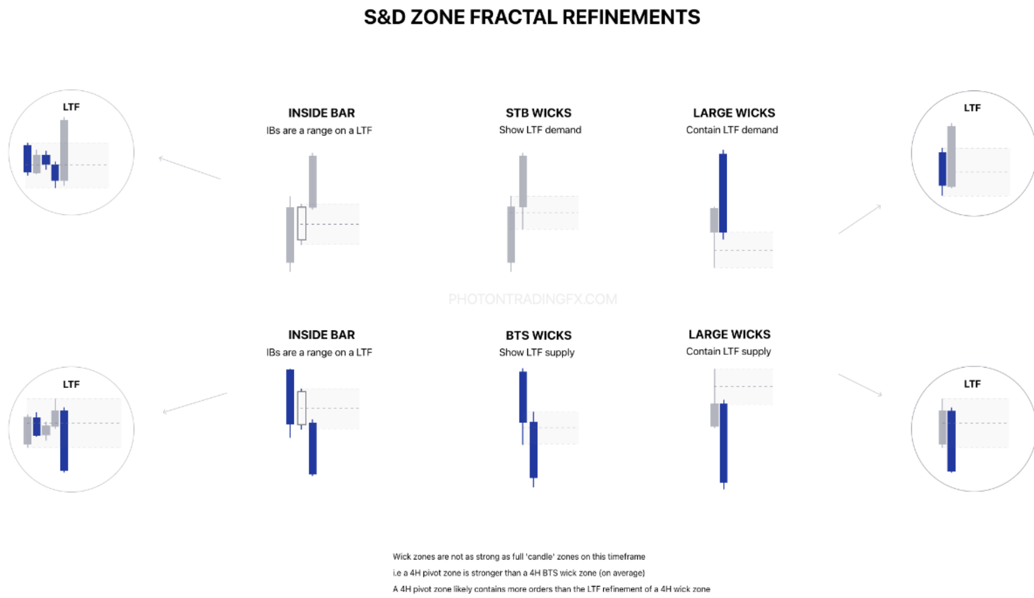


https://s3.tradingview.com/snapshots/y/ye4m09KH.png

در شکل زیر انواع حالت‌های اردربلاک فرکتال دیده می‌شود. اردربلاک‌های فرکتال هم مواردی هستند که نواحی عرضه/تقاضا در تایم بالاتر دیده می‌شود:

۱. اینساید بار ← هر اینساید بار نشان دهنده محدوده ایجاد شده بین یک سقف و کف فرکتال در تایم‌فریم‌های پایین است. (اینساید بار یعنی جایی که کندل بالا یا پایین کندل قبلی را نمی زند و سپس توسط کندل بعدی انگالف می‌شود.) اهمیتی ندارد اینساید بار صعودی یا نزولی باشد، فقط به دنبال این هستیم که قیمت پس از شکل گیری اینساید بار به کدام سمت حرکت کند (شکست صعودی=تقاضا/ شکست به پایین= عرضه).
۲. سایه‌های STB و BTS ← نشان می‌دهد در تایم‌فریم پایین قیمت پولبک زده و برگشته. بین دو سایه از دو کندل یک ناحیه رنج/پیووتی در تایم پایین وجود دارد.
۳. سایه‌های بزرگ ← در داخل سایه‌های بزرگ نیز یک ناحیه رنج/پیووتی در تایم پایین وجود دارد.

این سه حالت مخصوصا حالت وسط تنها برای نشان دادن اینکه یک ناحیه عرضه/تقاضا در تایم بالاتر چطور دیده می‌شود ترسیم شده است. ولی هنگامی که می‌خواهیم در یک تایم فریم مشخص اردربلاک همان تایم فریم را مشخص کنیم حالت مناسبی نیست:



https://s3.tradingview.com/snapshots/p/PMjBGd86.png

اعتبار اردربلاک

وقتی به نکاتی که درباره تشخیص نواحی عرضه/تقاضا یا اردربلاک گفته شد روی نمودار توجه کنید، مشخص می‌شود که در همه جای نمودار و همه تایم‌فریم‌ها چنین نواحی تشکیل می‌شود. چون علت حرکت مارکت همین تشکیل سطوح تعادل و سپس ایجاد عدم تعادل بین خریدار و فروشنده است. اما از کجا بفهمیم کدام یک از این نواحی اردرهایی داخل خود دارند که آن را به یک ناحیه عرضه/تقاضای ارزشمند برای ورود تبدیل می‌کند.

برای این منظور نیاز است تا لیستی از عوامل تشخیص نواحی معتبرتر و دارای اردرهای قوی‌تر و تاییدهای اضافی را در نظر بگیریم که شامل موارد زیر است:

۱. واقع شدن در مناطق خاصی از ساختار:

در جهت روند است یا خلاف روند،

در منطقه ارزان است یا گران،

نسبت آن با اردربلاک‌های موافق و مخالف تایم بالاتر چیست.

این امر کمک می‌کند که هم نواحی با احتمال موفقیت بالاتر را تشخیص دهیم و هم انتظار ما از اینکه قیمت بعد از واکنش به ناحیه مورد نظر چقدر ممکن است حرکت کند را مشخص می‌کند.

۲. آیا اردربلاک موقع تشکیل نقدینگی را سویپ کرده است یا نه (سویپ زون)

۳. آیا قیمت قبل از رسیدن به ناحیه یا اردربلاک مورد نظر نقدینگی معتبری را زده است یا نه.

۴. آیا مصرف نشده (میتیگیت نشده)؟ اگر میتیگیت شده چقدر از آن میتیگیت شده. آیا صرفا بخش کمی بوده یا صرفا ۲۵ درصد بوده اینکه مصرف شدن کمتر از ۳۰ درصد چقدر از اعتبار اردربلاک کم می‌کند بسته به بک تست خود تریدر دارد. اما بعضا گفته می‌شود که مصرف نیمی از ردربلاک ملاک است.

(وقتی قیمت در جای مناسبی است و شرایط ایده الی وجود دارد مثلا در اکستریم و در جهت روند است و... می‌توان از شرط میتیگیت نشده بودن صرف نظر کرد اما در پوزیشن های خلاف روند و جاهایی که تردید داریم بهتر است این شرط را در نظر بگیریم.)

۵. آیا بخشی از یک زنجیره میتیگیشن است؟ یعنی اردربلاک‌های قبل از آن به ترتیب یکدیگر را مصرف کرده باشند و اردربلاک مورد نظر آخرین حلقه از زنجیره میتیگیشن باشد.



در واقع بهتر است بین اردربلاک مورد نظر و اردربلاک قبل از آن فاصله یا گپ نیافتاده باشد و قیمت از خود اردربلاک مصرف نشده به جا نگذاشته باشد.

۶. آیا قبلا یک بار کار کرده و موجب واکنش در لگ راست شده یا واکنش مورد انتظار ما اولین واکنش است. آنچه در بند قبل گفته شد درباره میتیگیت شدن اردربلاک در لگ چپ به عنوان بخشی از زنجیره میتیگیشن و روند لگ چپ است اما در اینجا واکنش قیمت هنگام برگشت قیمت به اردربلاک در لگ راست است.

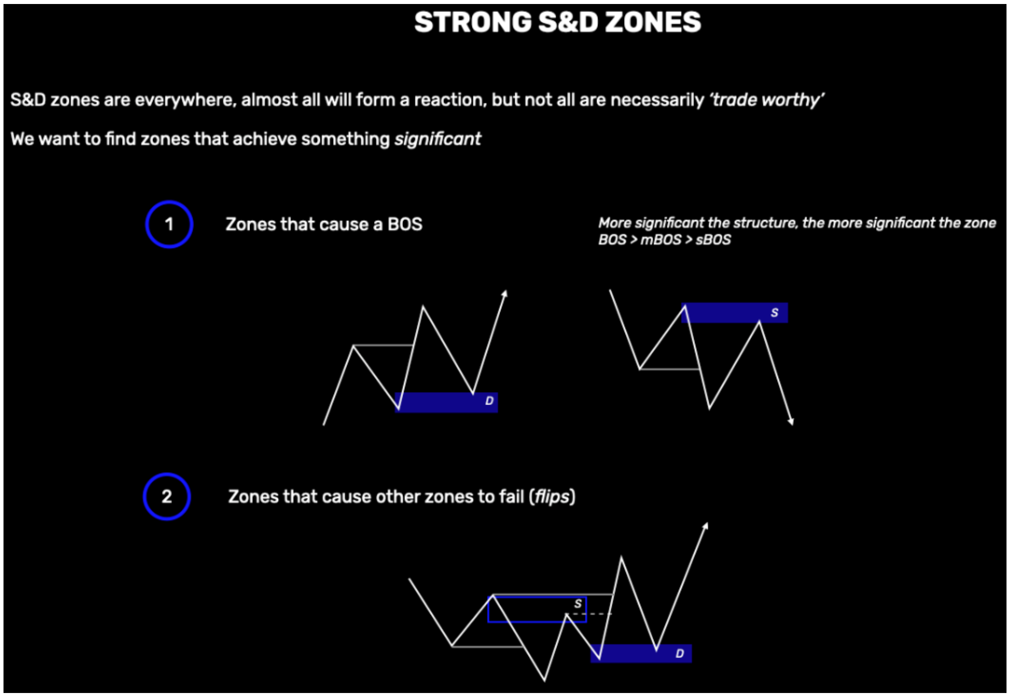
از شرط میتیگیت نشدن در لگ چپ بر اساس تحلیل ساختار و اینکه اردربلاک در کجای سوینگ قرار گرفته به خصوص اکستریم می‌توان صرف نظر کرد. اما میتگیت نشدن در لگ راست اهمیت بیشتری دارد و معمولا از آن صرف نظر نمی‌شود.



۷. آیا اردربلاک مورد نظر یک ناحیه مخالف را فلیپ کرده است؟ (در صورتی که سویپ زون هم باشد اعتبار بیشتری دارد.)

۸. دستاورد قابل توجهی داشته باشد به این معنا که منجر به شکست ساختار شده باشد. هر چه ساختار مذکور بزرگ‌تر و قوی تر و در تایم بالاتر باشد (باس>آی‌باس> آی‌آی باس>چاک) اردربلاک منشا شکست ساختار قوی تر خواهد بود. بنابراین شکست سقف/کف های ماژور بهتر از مینور و فرکتال است. به همین دلیل است که چاکی که موجب شکست یک سقف/کف آشکار شده قوی تر است از چاکی که موجب شکست یک سقف/کف فرکتال شده است.

به نظر مت در فصل عرضه و تقاضا مورد ۶ یا ۷ دو شرط ضروری برای اعتبار یک اردربلاک است و موارد دیگر در حد تایید برای افزایش اعتبار آن هستند (اگرچه در عمل برخی موارد دیگ هم همیشه مورد توجه هستند):



بنابراین دو شاخص اصلی برای تعیین یک ناحیه عرضه/تقاضا قوی و معتبر وجود دارد:

۱. مناطقی که باعث ایجاد شکست ساختار (BOS) شده ← هر چه ساختار مهم تر و بزرگ‌تر باشد، ناحیه قوی‌تر است (BOS سوینگ > BOS داخلی)

۲. مناطقی که باعث فیل شدن سایر مناطق شده (فلیپ).

طبیعتا وجود هر دو معیار با هم برای یک ناحیه دلالت بر قدرت و اعتبار بیشتر آن دارد. بنابراین ترکیب هر دو معیار احتمال موفقیت خوبی را ایجاد می کند، به ویژه زمانی که از دیگر شاخص‌های تحلیل به خصوص ساختار و... به درستی استفاده شده باشد.

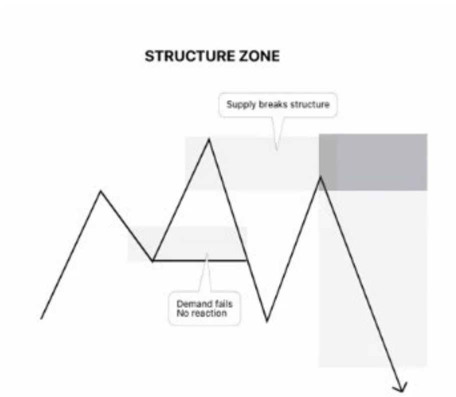
مت در بخشی که به بیان شرایط پلن و چک لیست فوتون پرداخته (بخش ۷ همین جزوه) فقط به شرط شکست ساختار به عنوان شرط ضروری اشاره می‌کند و فلیپ را از شرایط اختیاری دانسته است.

برخی شرایط بیرونی مانند جایگاه اردربلاک در ساختار از نظر فازهای چهارگانه، محل اردربلاک نسبت به باس (قبل یا بعد باس ـ در فاز a)، در منطقه ارزان/گران بودن، اپروچ قیمت موقع نزدیک شدن به اردربلاک و حداقل انتظار حرکتی (تارگت) برای واکنش به اردربلاک هم برای سنجش اردربلاک در نظر گرفته می‌شود.

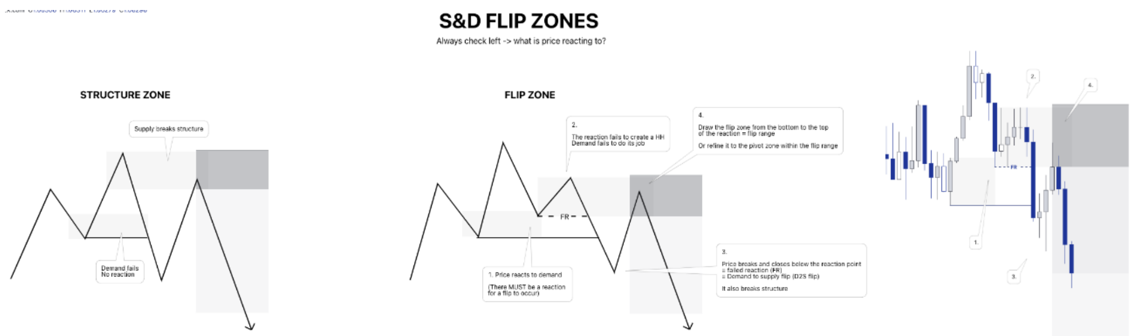
فلیپ زون

از طریق تشخیص اردربلاک ها یا نواحی عرضه و تقاضا تلاش داریم متوجـه شـویم چه جاهایی پول و حجم قابل توجه وارد بازار شده است تا وقتی قیمت بـه آن ناحیـه بازگشت ورود به پوزیشن را بررسی کنیم.

گفتیم یک شرط ضروری برای تشخیص اردربلاک مناسب این است کـه منجـر بـه شکست ساختار شده باشد که دست کم می‌تواند شکسـت یـک سـقف/کف فرکتـال باشد. در شکل زیر چنین حالتی رخ داده است. یعنی ناحیه کاندیـد بـرای ورود جـایی است که باعث شکست یک سقف/کف شده است. در شماتیک مذکور کف یا سـقفی که شکسته یک کف یا سقف قوی بوده چون خودش قبلا باعث یک شکست ساختار شده است. بنـابراین شکسـت آن دارای اهمیـت بیشـتری اسـت و بـه همـین دلیـل اردربلاک منشا شکست اعتبار نسبتا خوبی دارد.



اما در شکل وسط در شماتیک زیر شکست مذکور به سادگی رخ نداده، بلکـه قبـل از شکست درگیری شدیدی بین عرضه و تقاضا شکل گرفته که حاصل آن شکل گیری یک اردربلاک یا ناحیه عرضه/تقاضای جدید قبل از شکست سـقف/کف مـورد نظـر بوده است. به ناحیه یا اردربلاک جدیدی که این طور شکل گرفته ناحیه فلیپ گفتـه می‌شود. این حالت نشان می‌دهد که سقف یا کف قوی مورد نظر واقعا قـوی بـوده و اردرهای قابل توجهی در آن بوده که در همان حرکت اول اجازه عبور قیمت را نـداده است. اما در نهایت اردرهای مخالف قوی‌تر بوده و نمودار جهت گیری جدیـدی پیـدا کرده است. بنابراین اردربلاک فلیپ اعتبار بیشتری دارد از یک اردربلاک غیر فلیپ:

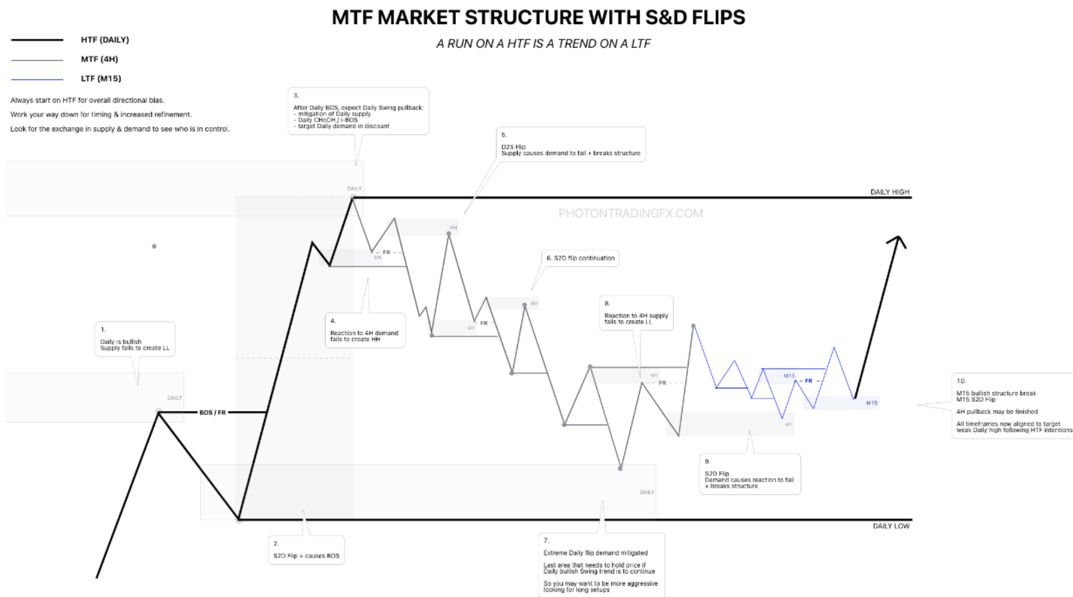


https://s3.tradingview.com/snapshots/w/w0HEEk7R.png

در شکل ابتدا انتظار این بوده که کف قوی هولد شود و باعث شود قیمت اخرین سقف ضعیف را بکشند اما واکنش ایجاد شده به اندازه کافی نبوده و موفق به شکست سقف نشده و قیمت دوباره به پایین برگشته است. شکست در زدن سقف و شکل گیری ناحیه فلیپ هنگامی قطعی می‌شود که بعد از شروع واکنش و برگشت قیمت، قیمت بتواند از منشا شروع حرکت جدید عبور کرده و زیر آن کلوز کند (FR=failed reaction) (جایی که با خط چین مشخص شده). در مرحله بعد هنگامی که کف هم شکسته شود اوردربلاک فلیپ تبدیل به یک اوردربلاک معتبر می‌شود که باعث شکست ساختار هم شده است.

از پایین سطحی که واکنش ناحیه فلیپ شروع شده تا بالاترین سطح آن، ناحیه فلیپ را تشکیل می‌دهد ولی گاهی این ناحیه رنج بزرگ است که در این صورت می‌توان آن را به اوردربلاک پیووتی در سقف ناحیه فلیپ ریفاین کرد.

برای تشخیص اینکه یک اوردربلاک فلیپ زون است یا خیر باید انقدر به سمت چپ نمودار برویم تا به لگ قبلی برسیم و بررسی کنیم که آیا سقف رنجی که اوردبلاک در آن قرار دارد، در واکنش به اوردربلاکی از گذشته بازار ایجاد شده است یا خیر.



https://s3.tradingview.com/snapshots/r/RWOnHa70.png

گاهی مثل شکل زیر واکنش فلیپ مانندی روی ابتدای اردرفلویی که یک کف راشکل داده تشکیل می‌شود ولی این واکنش قبل از آن شکل گرفته که قیمت به اردربلاک پیووتی اردرفلوی مورد نظر برسد در این موارد واکنش مذکور را فلیپ تلقی نمی‌کنیم و تنها ناحیه اکستریم برای ورود اعتبار دارد:



معیارهای فلیپ قوی/ ضعیف:

قوت ناحیه فلیپ وابسته است به قوت ادربلاکی که واکنش به آن فلیپ را می‌سازد.

بنابراین:

۱. در صورتی که ناحیه فلیپ روی کف/سقف قوی زده شده باشد اعتبار خیلی بیشتری دارد.

۲. اگر روی یک اردربلاک مصرف نشده شکل گرفته باشد ناحیه فلیپ قوی‌تری داریم.

۳. هر چه واکنشی که ناحیه فلیپ را می‌سازد بزرگتر باشد ناحیه فلیپ قوی تری داریم و هر چه جزئی و کوچک تر باشد ضعیف تر است.

مثلا در نمودار زیر بلافاصله بعد از اردربلاکی که در کف ساختار شکل گرفته (شماره ۱) اردربلاک دیگری شکل گرفته (شماره ۲) که اعتبار بیشتری دارد. بنابراین واکنش قیمت به آن در هنگام برگشت قیمت و ناحیه فلیپ حاصل از آن اعتبار بیشتری دارد (شماره ۳) اما این ناحیه فلیپ خیلی کوچک است و همچنین بلافاصله مصرف (میتیگیت) شده و سپس قیمت مجدد به اردربلاک ناحیه ۱ واکنش داده و ناحیه فلیپ جدیدی ساخته (شماره ۴). بنابراین در نمودار زیر ناحیه شماره ۴ فلیپ معتبر ماست:



۴. در صورتی که مثلا در یک روند صعودی ناحیه فلیپ دو سقف (یا بیشتر) زده باشد که دومی اولی را سویپ کرده ناحیه فلیپ معتبر و قوی تری داریم. در مورد فلیپ‌هایی که هنگام چاک در تایم ورود شکل می‌گیرند توصیه شده که فقط در

صورتی که فلیپ سویپ دار بود برای ورود استفاده شود. (غیر از شرایط خاص کـه در مدل‌های ورود بیان می‌شود)

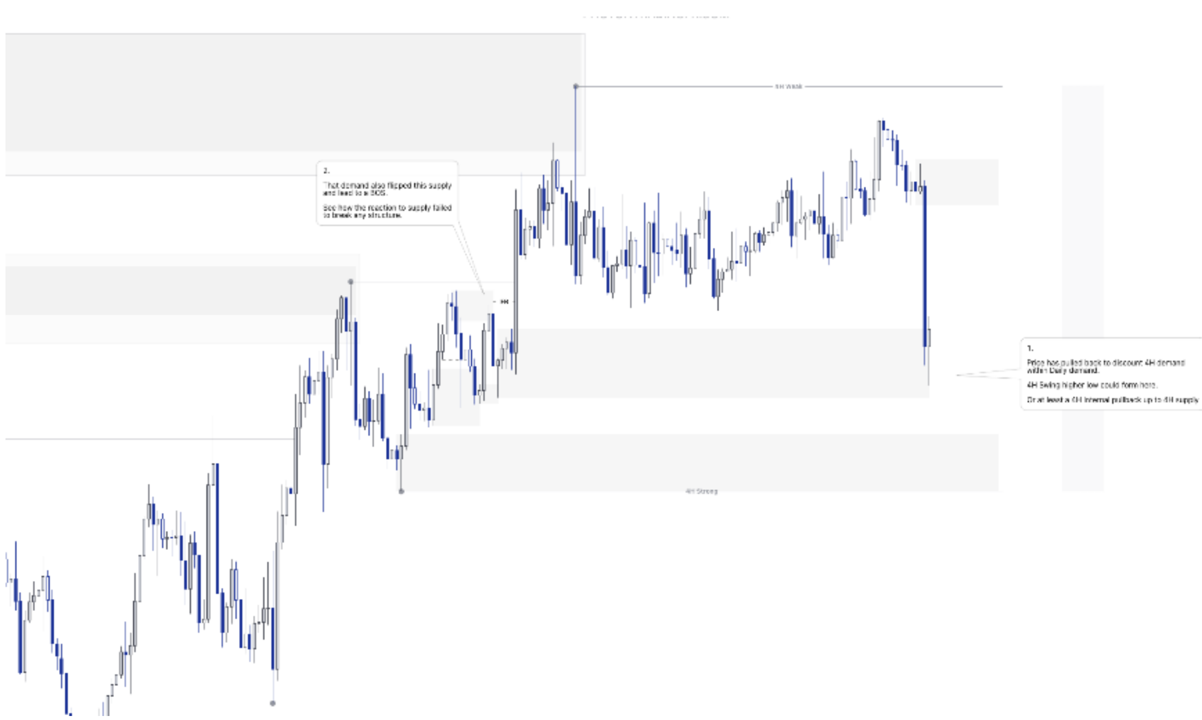
تطبیق بر نمودار

1) DAILY



https://s3.tradingview.com/snapshots/o/oKnku9HN.png

2) 4H



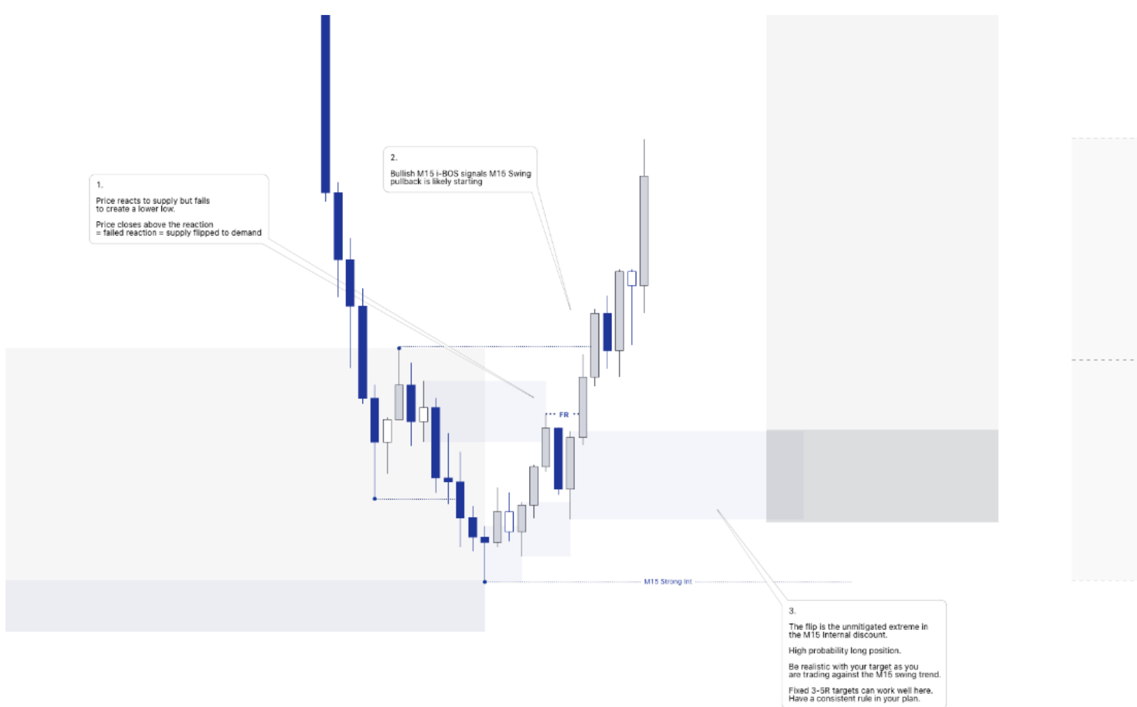
https://s3.tradingview.com/snapshots/f/fGwYpMAH.png

3) M15



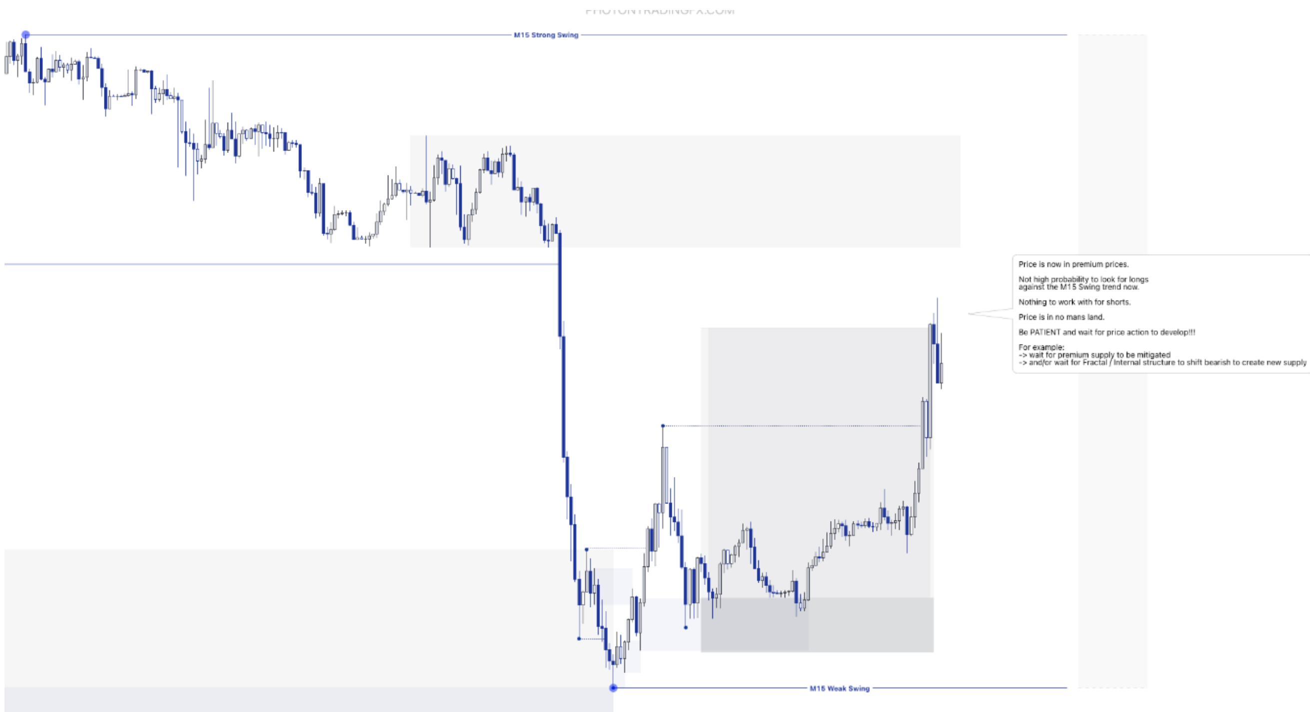
https://s3.tradingview.com/snapshots/q/QTvlAtgL.png

4) M15



https://s3.tradingview.com/snapshots/f/fhgSl8Iz.png

5) M15



https://s3.tradingview.com/snapshots/c/Cor4OfMm.png

6) M15



https://s3.tradingview.com/snapshots/h/HWD2gkQe.png

7) M15



https://s3.tradingview.com/snapshots/i/I1NBHlQy.png

8) M15



https://s3.tradingview.com/snapshots/i/iOMPibUb.png

9) M15



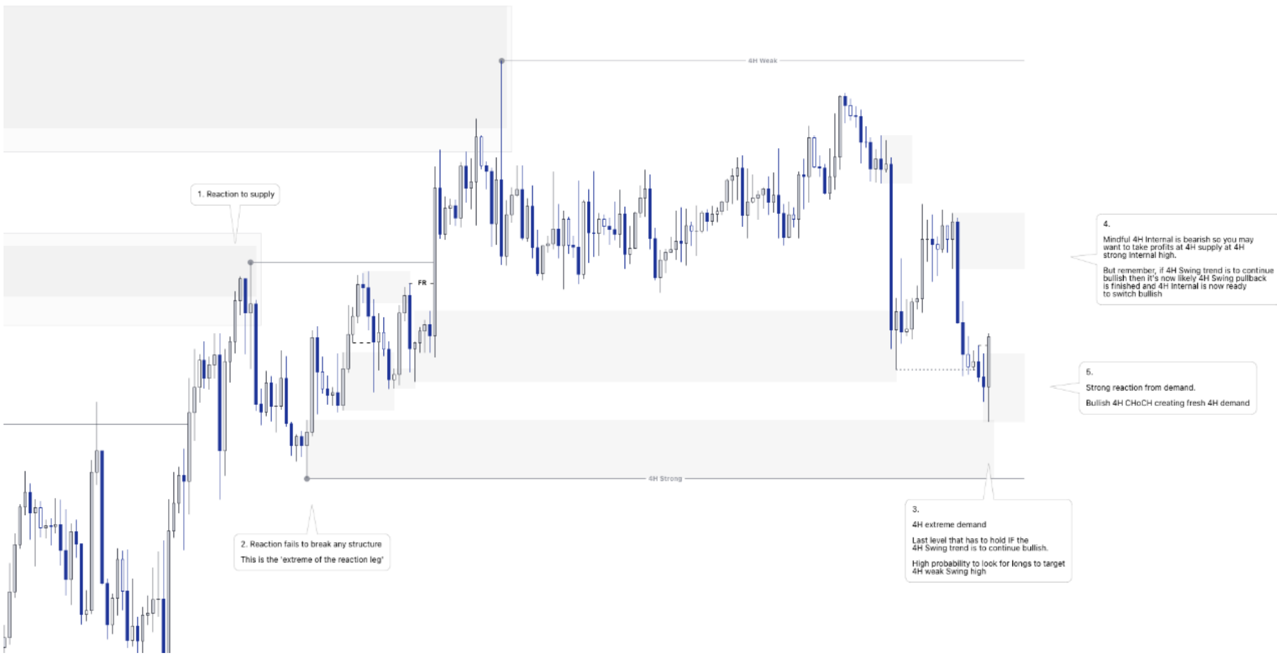
https://s3.tradingview.com/snapshots/h/hdf9Fsxd.png

10)



https://s3.tradingview.com/snapshots/j/JWS2qZgV.png

11) 4H



https://s3.tradingview.com/snapshots/v/vEhwVPfT.png

12) M15



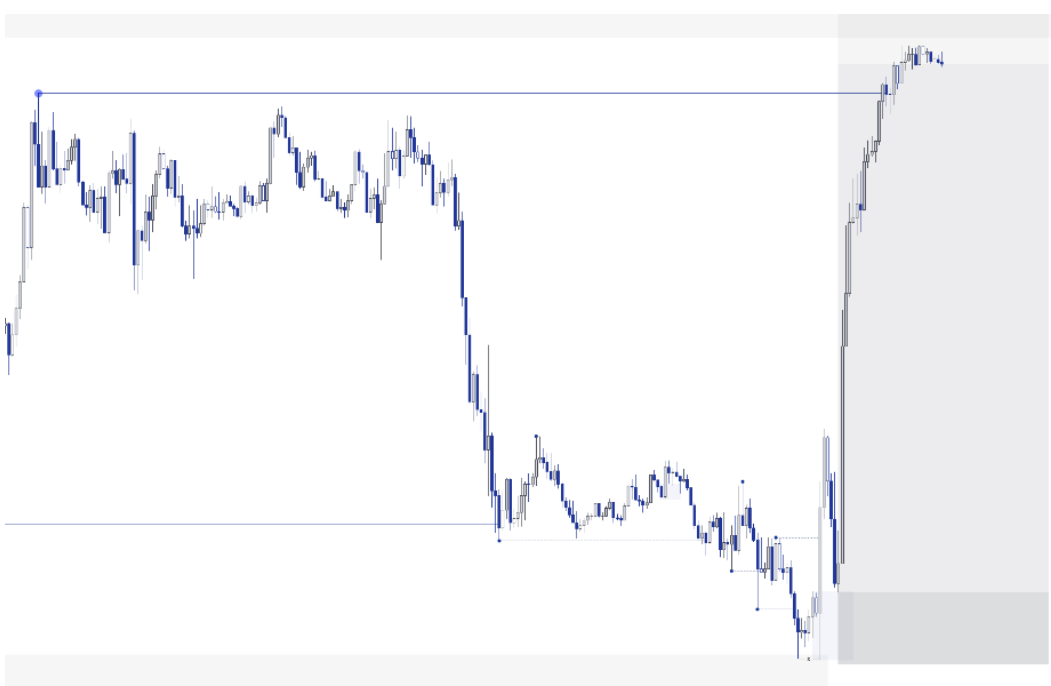
https://s3.tradingview.com/snapshots/w/wmlNT5Mv.png

13) M1



https://s3.tradingview.com/snapshots/1/1lgEyKjv.png

14) M15



https://s3.tradingview.com/snapshots/x/XOt71sbK.png

15) 4H



https://s3.tradingview.com/snapshots/9/9yt9tSrE.png

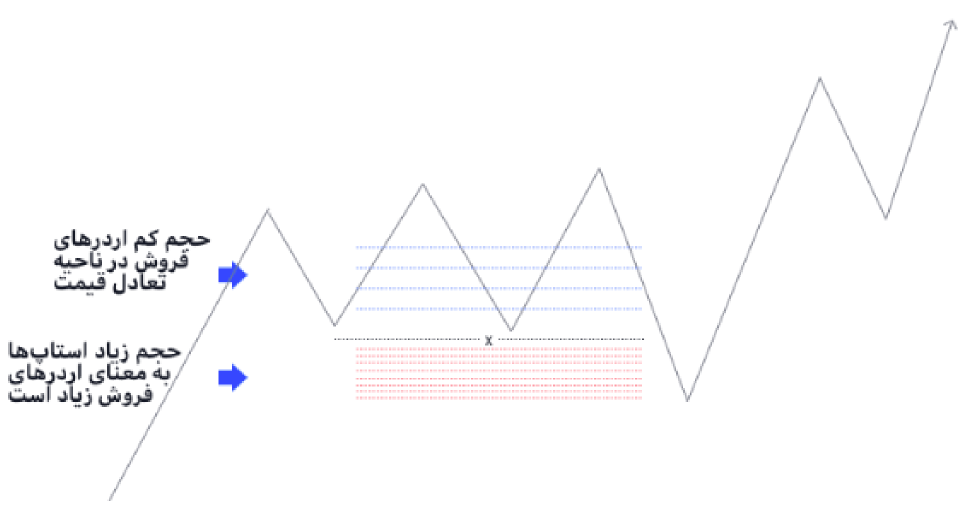
سویپ زون

همان طور که گفته شد با بررسی حرکات قیمت به دنبال پیدا کردن ردپای بانک‌ها و موسسات مالی بزرگ روی نمودار هستیم. یعنی اینکه جاهایی که پـول‌هـای بـزرگ وارد بازار شده است کجاست؟

پیش از این دو معیار برای تشخیص محل ورود پول‌های بزرگ گفته شـد: ۱. نـواحی که باعث شکست ساختار شده و ۲. یک ناحیه قوی دیگر را فلیپ کرده باشد.

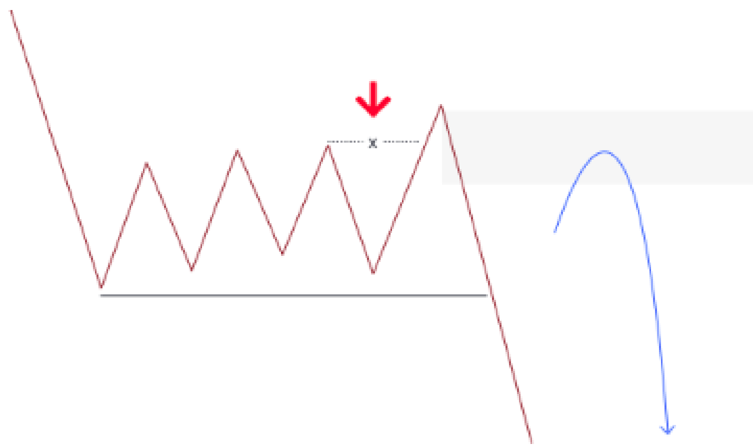
معیار سوم براش تشخیص پول‌های بزرگ، سـویپ کـردن نقـدینگی موقـع تشـکیل اردربلاک است.

در برابر هر اردر خرید، باید یک اردر فروش وجود داشته باشد وگرنه موجب اسلیپج در حرکت قیمت می‌شود و خرید مورد نظر در قیمـت ایـده‌آل محقـق نخواهـد شـد. در شکل زیر هنگامی که قیمت در یک ناحیه تعادل بین سلر و بایرهـا قـرار دارد تعـداد اردرهای خرید و فروش متعادل است و ارز مورد نظر بـا حجـم مشخصـی بـین آنهـا مبادله می‌شود. وقتی خریدار بزرگی می‌خواهد وارد شود، دیگر فروشنده کـافی بـرای خریدهای جدید وجود ندارد و در صورتی که اردرهایش را وارد بازار کند ایـن اردرهـا باعث جهش قیمت تا جایی خواهد شد که فروشنده‌های جدیدی وارد بازار شوند. امـا اگر قیمت کف ناحیه تعادل را بشکند استاپ‌لاس های زیادی زیر کف وجود دارد. هر کدام از این استاپ‌ها به معنای یک معامله فروش است. به همین دلیـل بانـک‌هـا و موسسات مالی بزرگ علاقمندند قیمت کف را بشـکند تـا بتواننـد در قیمـت بهتـری اردرهای خرید خود را اعمال کنند.



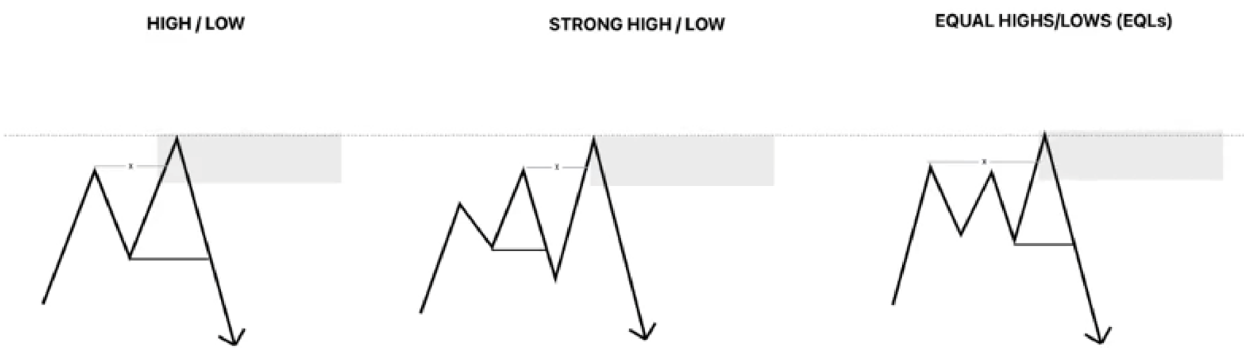
وقتی چنین سطوحی می‌شکند توقع این است که قیمت در همان جهت شکست به حرکت ادامه دهد. اما در اینجا اردرهای بسیار بزرگی که بانک‌ها برای خرید خود اعمال کرده‌اند باعث می‌شود قیمت دوباره به بالای کف برگردد و به حرکت صعودی خود ادامه دهد. از همین جا متوجه می‌شویم که شکست مذکور یک حرکت ظاهری برای جمع کردن نقدینگی زیر کف بوده است. به اردربلاک و ناحیه‌ای که به این روش با زدن نقدینگی شکل می‌گیرد سویپ زون گفته می‌شود. سویپ زون سومین نشانه و ردپای ورود پول‌های بزرگ است.

بنابراین سویپ زون به معنای اردربلاک یا ناحیه ای است که موقع شکل گیری آن نقدینگی یک سقف/کف قبلی زده شده و بعد حرکت اصلی قیمت شروع شده است:

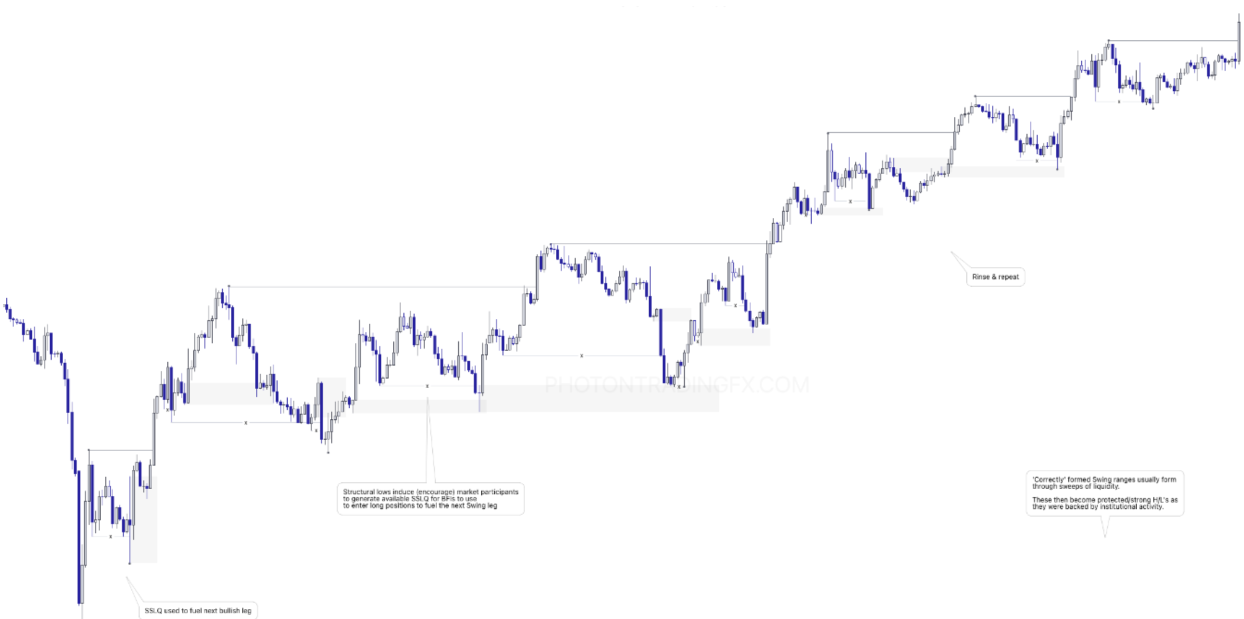


علت آن است که همان طور که در بحث اردربلاک گفته شد ما به دنبال رد پای موسسات و بانک‌ها و پول‌های بزرگ هستیم که بفهمیم در کدام سطح قیمتی وارد بازار شده‌اند. بانک‌ها برای خریدهای عمده خود نیازمند نقدینگی زیادی هستند به این معنا که در مقابل هر واحد خرید آنها باید به اندازه یک واحد فروشنده وجود داشته باشد و بالعکس. در خیلی از سطوح قیمتی در شرایط عادی چنین تعادلی در بازار برای یک خرید عمده و بزرگ وجود ندارد. بنابراین نیاز است تا با ایجاد حرکت‌های ساختگی در بازار چنین نقدینگی را ایجاد کنند. یکی از راه‌های ایجاد نقدینگی در بازار قبل از یک خرید عمده، زدن استاپ معامله‌گران در جهت خلاف جهتی است که بانک مورد نظر قصد معامله دارد. زیرا با زدن استاپ لاس نقدینگی زیادی ایجاد می‌شود. بنابراین هر گاه هنگام شکل گیری یک ناحیه عرضه/تقاضا و قبل از شروع یک حرکت، استاپ لاس و نقدینگی مهمی سویپ شد این امر می‌تواند از نشانه‌های ورود بانک‌ها و معاملات عمده به بازار باشد.

مثلا در شماتیک زیر یک بانک قصد فروش یک ارز خاص را دارد. بنابراین نیـاز دارد به میزانی فروش مورد نظر، خریدار در سطح قیمتی مورد نظر وجود داشته باشد. برای افزایش سفارش‌های خرید کافی است قیمت را به بالای یک سقف هـدایت کنـد. بـا این کار معامله‌گرانی که با شکست سقف به فکر خرید مـی‌افتنـد وارد معاملـه خریـد می‌شوند. همچنین معامله‌گرانی که قبلا در پوزیشن فروش بـوده‌انـد و اسـتاپ لاس خود را بالای سقف قرار داده‌اند استاپ می‌خورند که این به معنای فعـال شـدن یـک سری اردرهای خرید برای آن‌هاست. با این کار اردرهای خریدی که در شرایط عادی وجود نداشتند به بازار وارد شده و حالا بانک مورد نظر می‌تواند سفارش‌هـای فـروش خود را در مقابل آنها قرار دهد و چون حجم سفارش‌هـای فـروش مـذکور بالاسـت، باعث یک حرکت شارپ به سمت پایین می‌شود:

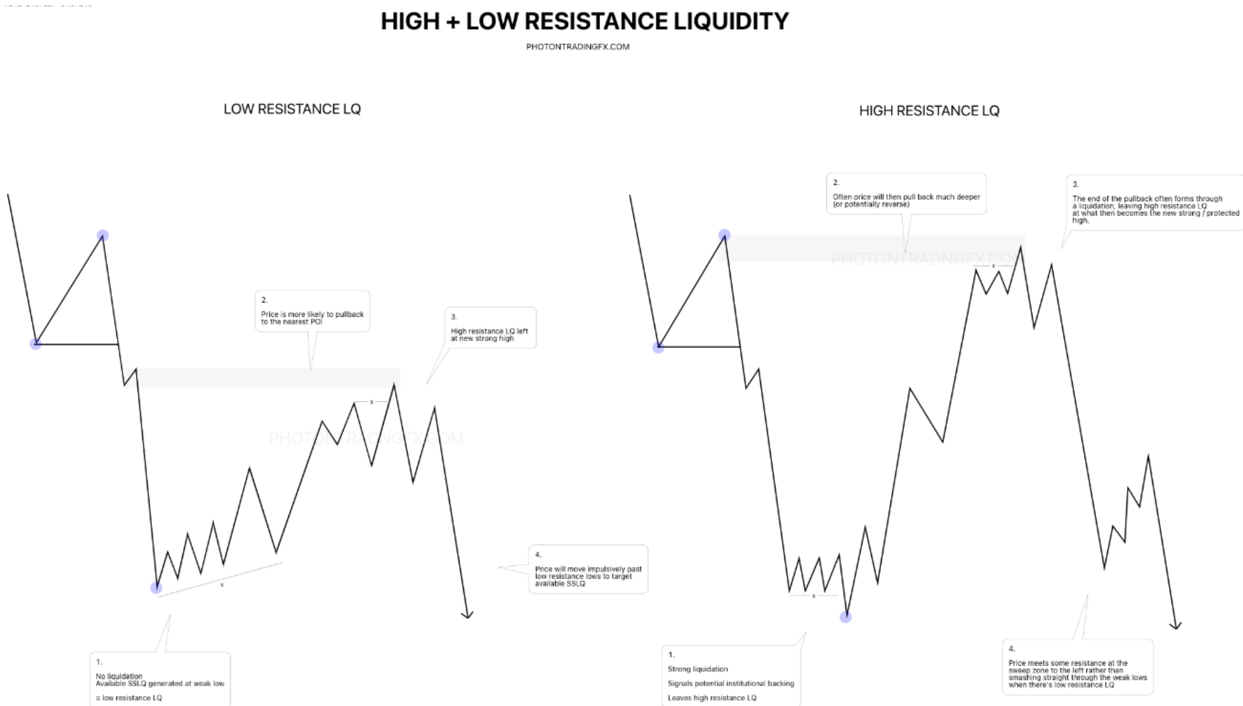


https://s3.tradingview.com/snapshots/a/a4ykKuOv.png



https://s3.tradingview.com/snapshots/0/0LfTY3bB.png

در مواردی که یک کف/سقف ضعیف نقدینگی را هنگام شکل گیـری سـویپ کـرده باشد، انتظار می‌رود قیمت قبل شکست و عبور از آن واکـنش قابـل تـوجهی داشـته باشد:



https://s3.tradingview.com/snapshots/p/PGtGzSwJ.png

معیارهای سویپ قوی/ ضعیف:

بهتره سویپی را در نظر بگیریم که قوی باشد. معیارهای سویپ قوی شامل موارد زیر است:

۱. نیازی نیست یک ساختار یا ناحیه قوی ساختاری سویپ شود اما هر چـه قـوی‌تـر باشد سویپ قوی‌تری داریم. بنابراین:

- سویپ شدن یک کف/سـقف پیـووتی قـوی تـر اسـت از سـویپ شـدن یـک کف/سقف کندلی و کف/سقف کندلی قوی تر است از یک کف فرکتال
- در صورتی که یک کف/سقف قوی سویپ شده باشد اعتبـار بیشـتری دارد از یک کف/سقف ضعیف
- در صورتی که نقدینگی دو کف/سقف زده شده باشد سویپ قوی‌تر است از زده شدن یک کف/سقف

۳. اگر با پیپ خیلی کم مثلا کمتر از یک پیپ سویپ کرده باشد سویپ ضعیف تـری است نسبت به وقتی سویپ خیلی مشخص باشه. سویپ کـم مشـکوک بـه ایکـوال هست.

۴. سطحی که نقدینگی آن سویپ شده باید نزدیک به سطح اردربلاک باشد مثلا دو تا سقف نباشند که اولی خیلی پایین تر شکل گرفته و دومی خیلی بالاتر.

۵. نمودار قبل و هنگامی سویپ نقدینگی از نظـر شـکل پـرایس اکشـنی زده شـدن نقدینگی را نشان بدهد. یعنی بعد از حرکت در جهت روند یک اصلاح نسـبتا فشـرده داشته باشیم و سپس یک حرکت نسبتا مومنتوم دار برای سویپ نقدینگی ایجاد شود و با مومنتوم هم باز گردد.

۶. کلا سویپی که با مومنتوم و با یک کندل رفت و برگشتی انجام بشود قوی تـره از سویپی که با مومنتوم کم باشه و چند تا کندل طول بکشه

۷. منظور از سویپ نقدینگی صرفا زدن نقدینگی با سایه نیسـت بلکـه ممکـن اسـت یک حرکت سویپ با بدنه هم انجام شده باشد ترجیحا اگر بقیه شرایط مثل مومنتـوم را داشته باشد.

در مثال زیر هنگامی که کف ساختار با بدنه شکسته شده انتظـار مـی‌رفـت کـه ایـن حرکت یک شکست ساختار یا باس باشد، اما بعد از اینکه حرکت با مومنتوم برگشـت و سپس آخرین سقف ساختار با بدنه شکسته شـد متوجـه شـدیم کـه شکسـت کـف ساختار در واقع یک سویپ نقدینگی بوده اسـت. اگرچـه هـر گـاه مومنتـوم رفـت و برگشت قیمت خیلی بالاست و اردربلاک منشا شکست کف (pbl) هـم بـه سـرعت زده شده در همان مرحله می‌توان حدس زد که این یـک زده شـدن نقـدینگی بـوده است.



گاهی این طور میشه ینی اردربلاک منشا ایباس فیل میشه میفهمیم اون ایباس نبوده سویپ بوده ولی پی.بی.ال ش هم با سایه زده میشه و موفق نمیشه ایباس نزولی هم بزنه و این ممکنه علامت این باشه ک کف سویپ شده و میخاد ی ایباس صعودی دیگ زده بشه خلاصه اینجاها باید صبر کرده که به یک طرف ایباس جدید زده بشه و هر دو سناریو معتبره:



البته اینجا چون مومنتوم خیلی قوی قبل ش داشتیم و سویپ بالایی با بدنه بوده و پایینی با سایه سناریوی بای مقدم است. ولی مت معتقد است هر وقت در تایم آسیا حرکت به صورت رنج ساید یا شیب ملایم و فشرده صورت گرفته سپس در سشن

اروپا مومنتوم وارد شده و سقف آسیا سویپ مـی‌شـود و همزمـان یـک اردربـلاک ۴ ساعته را هم میتیگیت می‌کند و به صورت وی شیپ بر می‌گردد پـایین، بـه احتمـال زیاد شروع یک روند نزولی رو خواهیم داشـت و شکسـت سـقف آخـر در واقـع یـک سویپ نقدینگی بوده است.

همچنین سویپ یک کف/سقف اصلی علاوه بر اینکه مـی‌توانـد نشـانه ایجـاد یـک حرکت قوی بر خلاف جهت سویپ باشد، می‌تواند نشان دهنده این باشد کـه ناحیـه تقاضا/عرضه مورد نظر ضعیف است و احیانا کمی بعد می‌خواهد بشکند.

فلیپ سویپ زون

اگر ناحیه فلیپ همزمان سویپ زون هم باشد یعنی قبل از شروع حرکت اصلی سقف یا کفی قبل از خود را سویپ کرده باشد، ناحیه مورد نظر نسبت به فلیـپ یـا سـویپ تنها، قدرت زیادی دارد.

بر اساس مطالبی که گفته شد برای ترسیم نـواحی بـا اعتبـار بـالا فراینـد زیـر طـی می‌شود:

۱. نواحی عرضه/تقاضا را تعیین می‌کنیم (نواحی پیووتی).

۲. مشخص می‌کنیم کدام نواحی عرضه/تقاضا اعتبار دارنـد: باعـث شکسـت سـاختار شده‌اند (فرکتال/داخلی/سوینگ)

۳. فلیپ زون‌ها را از میان آنها مشخص می‌کنیم: به چپ نگاه می‌کنیم تا ببینیم کدام یک در واکنش به یک ناحیه میتیگیت نشده ایجاد شده است.

۴. سویپ زون: آیا ناحیه فلیپ مورد نظر یک سـقف/کف قبـل خـود را موقـع شـکل گیری سویپ کرده است.

تطبیق بر نمودار



Reaction sweep

https://s3.tradingview.com/snapshots/o/oxlpPsYv.png



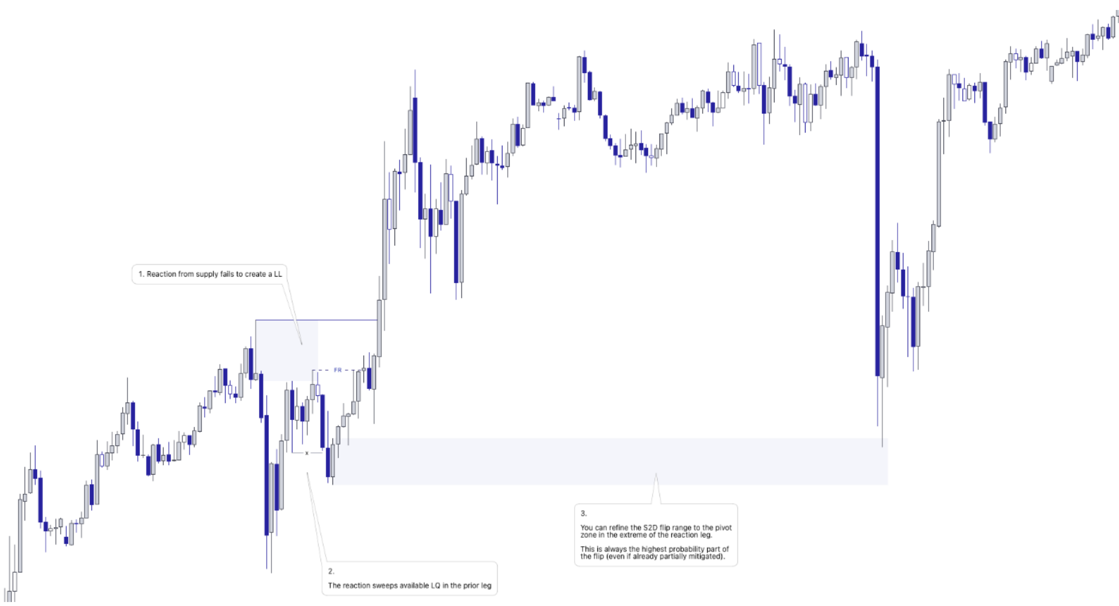
Initial flip reaction gets swept

https://s3.tradingview.com/snapshots/l/lDkfJm88.png



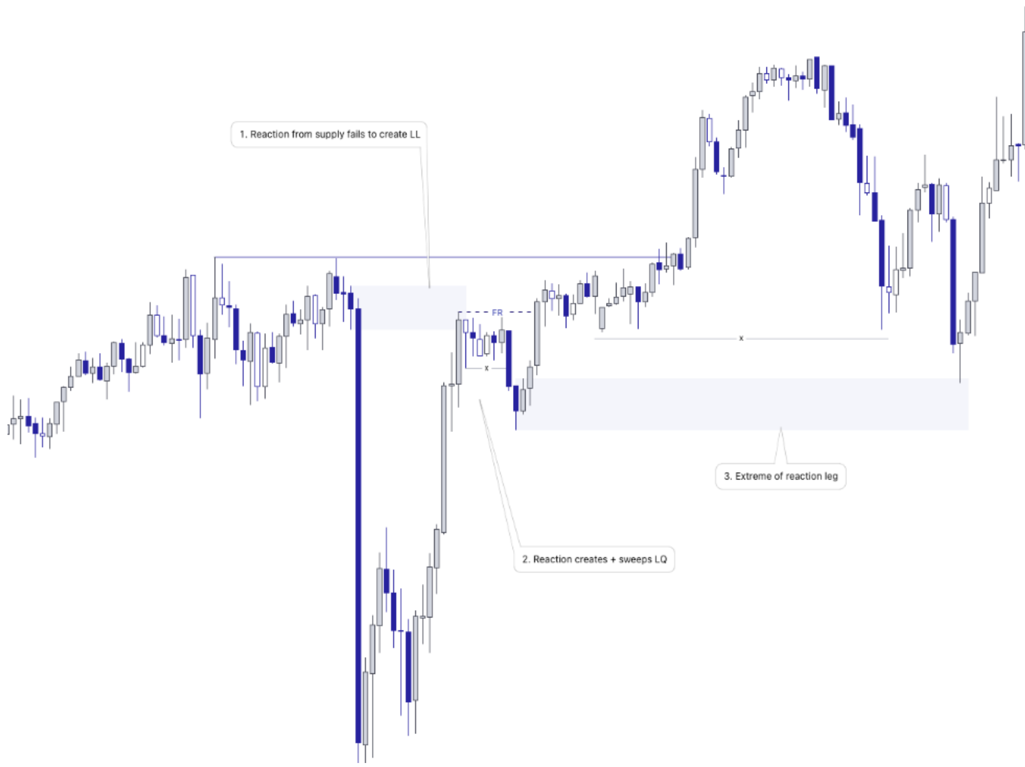
Reaction sweep

https://s3.tradingview.com/snapshots/f/FP7cHBXN.png



Flip sweeps prior leg

https://s3.tradingview.com/snapshots/a/AfGTN4Fq.png



Reaction EQLs sweep

https://s3.tradingview.com/snapshots/c/CGF5H4pj.png

۲. ورود بر اساس فازهای حرکتی

مفهوم فازهای حرکتی در ساختار چندلایه

در شکل زیر خط پررنگ نشان دهده حرکت قیمت در تایم فریم ساختار است.

همان طور که گفته شد، پس از هر شکست ساختار انتظار داریم قیمت پولبکی را در جهت خلاف روند ساختار شروع کند. اینکه قیمت در مرحله پولبک تایم ساختار است یا پولبک تمام شده و در سوینگ لگ بعدی است تعیین کننده رویکرد و شیوه ورود و خروج و انتظار ما از حرکت قیمت است.

بنابراین، پس از ترسیم آخرین شکست ساختار در ۴ ساعته باید مشخص کنیم که آیا هم اکنون قیمت در فاز پولبک است و بر خلاف روند ۴ ساعته حرکت می‌کند (کانتر

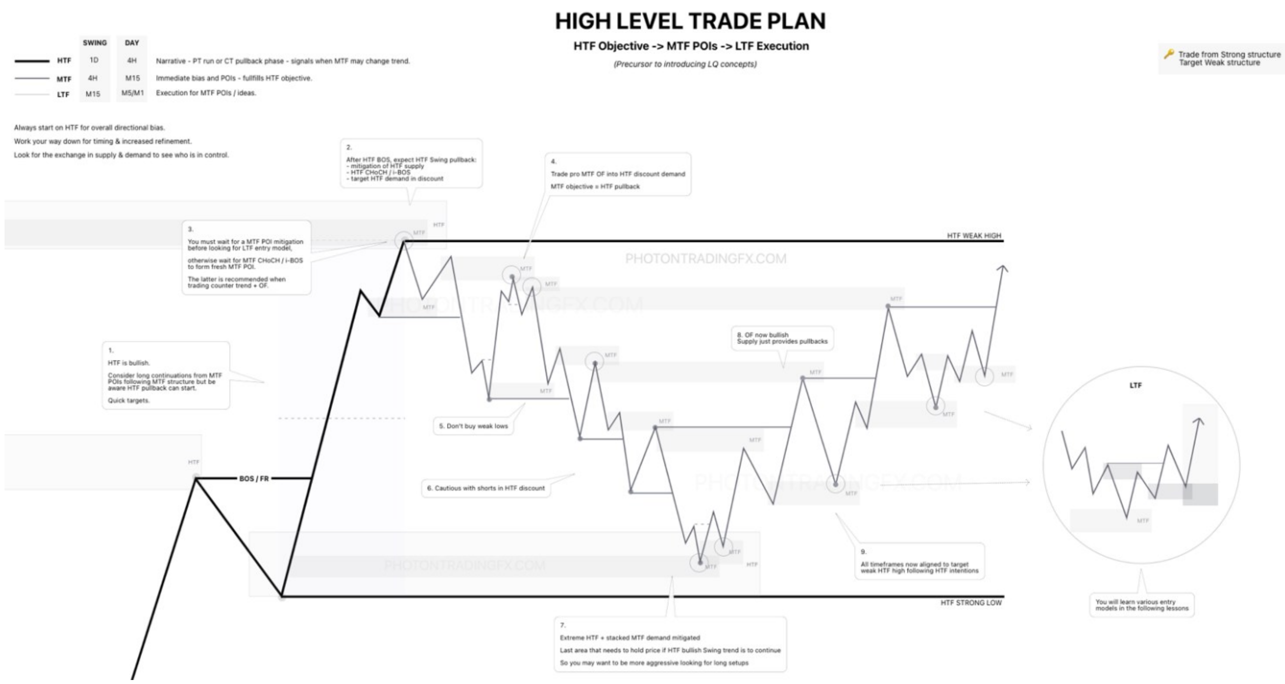
ترند) یا پولبک تمام شده و در جهت روند ۴ ساعته در حال حرکت است (پـرو ترنـد). پس از پایان پولبک انتظار می‌رود قیمت در جهت روند ۴ ساعته قرار گیـرد و دسـت کم تا سوینگ های (سقف ضعیف) در روند صعودی و تا سوینگ لو (کف ضـعیف) در روند نزولی ادامه یابد.

این حرکت قیمت بین سوینگ های و لو در جهت رونـد تـایم سـاختار یـا در جهـت خلاف روند تایم ساختار (پولبک) را در تایم فریم ساختار داخلی (که معمولا تـایم ۱۵ دقیقه است) بررسی می‌کنیم. یعنی اگر روند ۴ ساعته صعودی است و پس از باس در تایم میانی (۱۵) نزولی شد نشانه شروع پولبک است و اگر بعد از رسیدن به دیسکانت دوباره صعودی شد نشانه پایان پولبک و شروع سوینگ بعدی است.

تایم فریم اصلی برای تحلیل و ترید همین تایم فریم میانی اسـت یعنـی معمـولا در جهت روند تایم فریم میانی و روی اردربلاک های تایم فریم میانی تریـد مـی‌کنـیم. بنابراین در موارد مشابه شماتیک زیر که روند صعودی است تا وقتی تایم فریم میانی در جهت سوینگ ۴ ساعته یعنی صعودی است به دنبال پوزیشن بـای در اردربـلاک های صعودی تایم میانی هستیم و هر گـاه در فـاز پولبـک قـرار گـرفتیم بـه دنبـال پوزیشن سل در اردربلاک های نزولی تایم میانی هستیم.

حرکت قیمت در تایم‌فریم ۱۵ مین هم خودش دارای یک ساختار مشابه تایم سـاختار است. یعنی دارای شکست ساختار (اینترنال باس‌ها) و سـوینگ هـای و لـو و نـواحی عرضه/تقاضا و منطقه ارزان و گران است و به همه این موارد هنگام ورود در نـواحی عرضه/تقاضا یا اردربلاک‌های تایم میانی توجه می‌شود.

نکته مهم در اینجا این است که از کجا متوجه شویم فاز پولبک شروع شده تا شـروع به پوزیشن های سل در جهت روند تایم میانی کنیم و از کجا متوجه شـویم پولبـک تمام شده تا شروع به پوزیشن های بای در جهت روند تایم میانی+تایم ساختار کنیم. نشانه ی شروع یا پایان پولبک مشاهده چاک تایم میانی یا چاک+اینترنال باس پـس از برخورد قیمت به یک ناحیه عرضه/تقاضا از تایم ساختار است.



https://s3.tradingview.com/snapshots/m/mKk2nhn8.png

باید توجه داشت که اگرچه تایم اصلی ما برای تحلیل و ترید تایم میانی است اما هدف تایم میانی، تکمیل و شکل دادن به ساختار تایم ساختار است. یعنی مثلا در شماتیک فوق که روند تایم ساختار صعودی است، تایم میانی همواره سقف و کف های بالاتر را برای شکل دادن به سوینگ تایم ساختار می‌سازد و سقف و کف های پایین تر را برای شکل دادن به روند پولبک تایم ساختار می‌سازد. هدف پولبک هم بردن قیمت به منطقه دیسکانت یا اکستریم ساختار ۴ ساعته است. بنابراین هدف روند نزولی در تایم میانی با رسیدن قیمت به یک ناحیه مهم در منطقه دیسکانت یا اکستریم ۴ ساعته محقق شده و پایان می‌پذیرد.

نواحی مناسب ورود به پوزیشن

حالت غیر ریسکی و توصیه شده برا ورود این است که همیشه در جهت روند تایم میانی پوزیشن بگیریم. یعنی اگر روند ۴ اچ صعودی است، در پولبک های آن به تایم ۱۵ مین برویم و نواحی عرضه را برای سل دنبال کنیم و به فکر بای نباشیم. پس از پایان پولبک هم نواحی تقاضا را برای بای دنبال کنیم و به دنبال سل نباشیم.

در اولی ناحیه عرضه/تقاضا در شروع پولبک یا پایان پولبک هم نشانه های قطعی تر تغییر روند تایم میانی (آیباس) را پس از واکنش به اردربلاک ۴ ساعته ببینیم و به مشاهده چاک فرکتال اکتفا نکنیم. بنابراین برای مرحله شروع یا پایان پولبک بهتر

است آیباس ۱۵ مین را ببینیم و سپس در برگشت قیمت به منشا آیباس روی ناحیه ۱۵ دقیقه منشا آیباس وارد شویم. برای اطمینان بیشتر می‌توانیم روی ناحیه مذکور هم تایید تایم پایینی را بگیریم. مجددا حالت مطمئن تر این است که بعد از برگشت قیمت به ناحیه منشا آیباس مذکور، منتظر چاک ۱۵ مین بمانیم و در برگشت قیمت به منشا چاک تایید تایم پایینی را برای ورود به پوزیشن بگیریم. [این حالت برای مواردی که طول سوینگ ۱۵ مین و عمق آن زیاد است مناسب است]

با وجود آنچه گفته شد، در فاز پایان پولبک و شروع سوینگ لگ جدید، می‌توان اگرسیوتر عمل کرد. به این شکل که اگر پس از برخورد قیمت به ناحیه ریفاین شده ۱۵ مین در داخل اردربلاک ۴ ساعته می‌توان مستقیما به تایم پایینی رفت و با تایید تایم پایینی وارد پوزیشن شد. حالت محتاطانه تر این است که منتظر چاک یا آیباس ۱۵ مین باشید و در برگشت قیمت به منشا چاک یا آیباس به طور مستقیم یا با تایید در تایم پایینی وارد پوزیشن شوید (اگر قیمت به اکستریم رسیده نیازی نیست برای قطعی شدن تغییر روند منتظر آیباس شویم چون اکستریم آخرین سنگری است که انتظار می‌رود قیمت را برگرداند).

نکات

نکته۱: بعد از هر شکست ساختار (باس) در تایم ساختار (۴ اچ) به ترید کردن روی نواحی تایم میانی ادامه می‌دهیم، اما چون بعد از شکست ساختار انتظار داریم پولبک از هر نقطه ای شروع شود، در تعیین تی پی ها باید احتیاط بیشتری کنیم یعنی تی پی های کوچک تری قرار دهیم. اما قبل از شکست ساختار می‌توان دست کم یکی از تی پی ها را روی سقف ضعیف تایم ساختار (در روند صعودی) یا کف ضعیف تایم ساختار (در روند نزولی) قرار داد که معمولا ریواردها بالایی را نتیجه می‌دهد.

نکته۲: بهتر است هیچ گاه در جهت خلاف روند تایم میانی پوزیشن نگیرید. یعنی در مثال شماتیک بالا همواره در فاز پولبک فقط به پوزیشن های سل و پس از پایان پولبک و در فاز در جهت سوینگ ۴ اچ تنها به پوزیشن‌های بای فکر کنیم.

نکته۳: هر گاه در فاز پولبک ترید می‌کنید با نزدیک شدن یا وارد شدن به منطقه دیسکانت سوینگ تایم ساختار (اگر روند تایم ساختار صعودی است) تی پی‌های کوتاه تری در نظر می‌گیریم. حتی برای اطمینان بیشتر می‌توانید با وارد شدن به منطقه دیسکانت کلا از گرفتن پوزیشن شورت خودداری کنید.

نکته۴: همان طور که گفته شد با مشاهده نشانه هـای پایـان پولبـک تـایم سـاختار (چاک ۱۵ مین) به دنبال پوزیشن گرفتن روی ناحیه منشا چاک هستیم. اما اگر بعد از چاک قیمت تا ناحیه عرضه ساختار ۱۵ مـین نزولـی رفـت و برگشـت ممکـن اسـت بخواهد به روند نزولی خود ادامه دهد بنابراین رفتن به تایم ورود برای پوزیشن بـای ریسکی است. در این موارد می‌توانیم صبر کنیم تا قیمت واکنش بدهد و اخرین ناحیه عرضه ۱۵ مین را بکشند و در واقع یک آیباس شکل بگیرد و در برگشت قیمـت بـه منشا آیباس برای تایید به تایم پایینی برویم و سپس پوزیشن بای بگیریم.

نکته۵: با توجه به آنچه گفته شد معنای این جمله که تایم اصلی برای تحلیل و ترید تایم میانی است مشخص می‌شود. همواره در جهت روند تایم میـانی تحلیـل و تریـد می‌کنیم اما برای اینکه بدانیم احتمال تغییر روند چقدر اسـت و تـی پـی هـا را کجـا محتاطانه تر انتخاب کنیم همواره به جایگاه قیمت در ساختار تایم ساختار هـم توجـه داریم یعنی آیا قیمت در جهت سوینگ تایم ساختار است یا در فاز پولبک است و اگر در فاز پولبک است به منطقه دیسکانت و یا اکستریم رسـیده یـا خیـر و اگـر در فـاز سوینگ است آیا به ناحیه ای که احتمال شروع پولبک از آنجا می‌رود رسیده است یـا خیر.

نکته۶: به نظر مت برای شـروع مـی‌تـوان از سـت تـایم فـریم سـوینگ تریـدینگ (روزانه/۴اچ/۱۵مین) استفاده کنید چون هر چه تایم فریم کوچک تر شـود مخصوصـا تایم ۱ دقیقه به دقت و مهارت بیشتری نیاز است. (اما باید توجه داشت که تایم‌فـریم را نمی‌توان به نمودار و ساختار تحمیل کرد. اگ ساختاری بزرگ‌تر باشد حتما بایـد در روزانه تحلیل شود و اگر کوچک‌تر باشد در ۴ ساعته بنابراین همیشـه نمـی‌تـوان بـه صورت خشک و غیرقابل انعطاف به یکی از این دو به عنـوان تـایم سـاختار مراجعـه کرد)

نکته۷: اینکه گفته شد تنها در نواحی تایم میانی پوزیشن بگیرید تنها یـک احتیـاط و برای اطمینان بیشتر است. ولی امکان این وجود دارد که پس از واکنش و جدا شـدن قیمت از ناحیه ۱۵ مین در جهت اردرفلوی تایم ۱ تا ۵ دقیقه نیز روی نـواحی همـان تایم ها ترید کرد اما این کار به مهارت و تسلط بیشتری نیاز دارد.

نکته ۸: اگر می‌خواهید پوزیشن‌های مطمئن تری داشته باشید فقط در فاز ۱ و ۳ تایم ساختار و فاز ۱ تایم میانی ترید کنید. در صورتی که آیباس تایم میانی بـزرگ بـود و انتظار می‌رفت طول پولبک تایم میانی هم به اندازه کافی بزرگ باشد می‌توان فـاز ۳ تایم میانی را هم اضافه کرد.

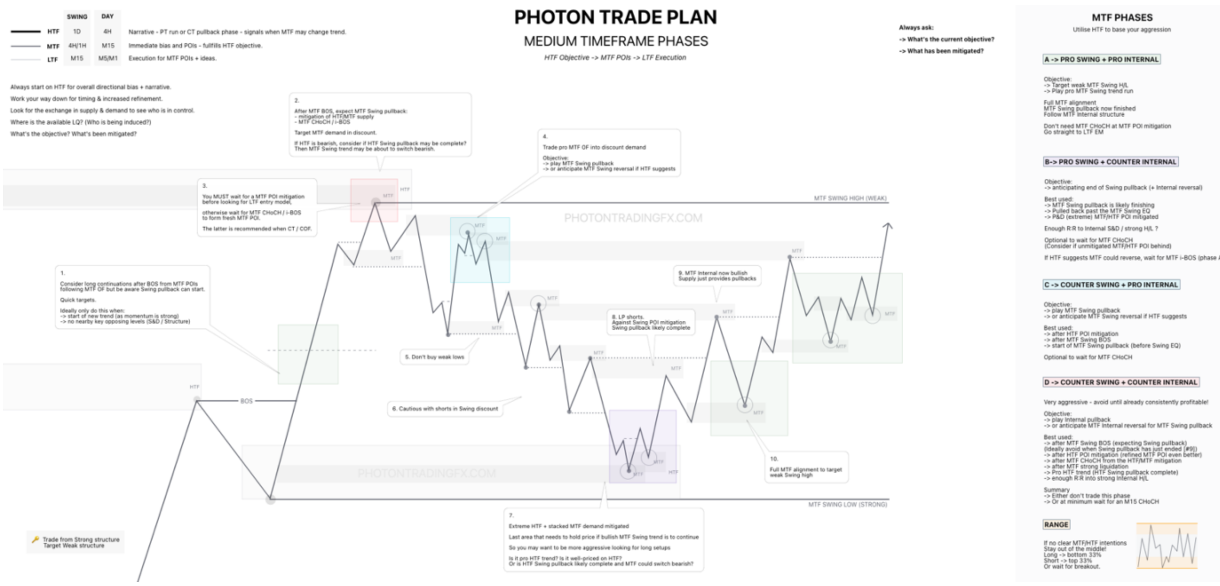
نکته ۹: مبحث فازهای چهارگانه صرفا مختص تایم‌فریم ساختار نیست. بلکه در هـر تایم فریمی که یک شکست ساختار و به دنبال آن سوینگ و پـولبکی داشـته باشـیم بالتبع می‌توان فاز سوینگ و فاز پولبـک را از یکـدیگر تفکیـک کـرد. اگـر احسـاس می‌کنید تایم فریم مناسب برای باس و سوینگی کـه در حـال تحلیـل آن هسـتید ۱ ساعته است بحث فازها را می‌توان بر آن تطبیق داد و در تایم پایین‌تر ساختار داخلـی آن را تحلیل کرد. اگر در تایم ۱۵ دقیقه هم باس و سوینگ داریم طبیعتا سـاختار ۱۵ ما از نظر فازبندی فاز سوینگ و فاز پولبک دارد. مت سـاختار داخلـی تـایم ۱۵ را در همان تایم ۱۵ ترسیم می‌کند اما تایم ۵ دقیقه هم برای ترسیم سـاختار داخلـی تـایم ۱۵ دقیقه (بر اساس بک‌تست شخصی خود فرد) قابل استفاده است. بنـابراین تـلاش کنید مطق فازبندی‌ها را یاد بگیرید تا بتوانید با انعطـاف‌پـذیری کـافی آن را بـر هـر ساختار و تایم‌فریمی که نیاز بود تطبیق بدهید.

نکته ۱۰: مت در ریکپ‌ها ساختار داخلی یا اینترنال را به اینترنـال کوچـک و بـزرگ تقسیم می‌کند. اینترنال کوچک، مشابه همان ساختار داخلی داخلی است.

اهداف و الزامات فازهای حرکتی

تقسیم بندی فازهای حرکت قیمت بر اساس جایگاه قیمت نسبت به ساختاری که در تایم فریم ساختار داریم صورت می‌گیرد. دلیل این تقسیم بندی آن است کـه میـزان ریسک ترید و قواعد مدیریت پوزیشن در هر کدام متفاوت است.

اگر به تازگی می‌خواهید شروع به ترید کنید، ابتدا از کم ریسک ترین فاز شروع کنید و فقط همان را ترید کنید و تا وقتی به مهارت و موفقید در ترید آن فاز نرسیدید فـاز بعدی را ترید نکنید.



https://s3.tradingview.com/snapshots/8/81mjo0xs.png

فاز ۱ (در جهت اردرفلوی ٤ اچ و ١٥م)

تعریف:

فاز ۱ از هنگامی شروع می‌شود که پولبک تایم ساختار تمام شده و روند تایم میانی با روند تایم ساختار یکی شود. بنابراین با زده شدن اولین آیباس فاز ۱ شروع می‌شود. در این فاز ترید در جهت تایم میانی کمترین ریسک را دارد چون روند تایم میانی با روند تایم ساختار یکسان است.

هدف:

هدف حرکت قیمت در فاز ۱ این است که قیمت را اول به سقف ضعیف ساختار داخلی (۱۵مین) و دوم به سقف ضعیف تایم ساختار (۴اچ) برساند. (بعد از شکل گیری باس تایم ساختار هم کماکان در فاز ۱ قرار داریم و به پوزیشن در جهت تایم میانی ادامه می‌دهیم اما باید توجه داشته باشیم که ممکن است پولبک تایم ساختار کمی بعد شروع شود که مستلزم احتیاط در ورود و تی‌پی گذاری است.)

الزامات:

- ورود در اردربلاک‌های معتبر منطقه دیسکانت و یا اکستریم تایم فریم میانی در جهت روند تایم ساختار

- چاک تایم میانی نیاز نیست و فقط تایید تایم مینور کافی است
- ریسک ترید در فاز ۱ قبل از رسیدن قیمت به های/لو تایم ساختار و شکل گیری باس جدید در این تایم‌فریم کمتر است از ترید بعد از عبور قیمت از های/لو تایم ساختار و ایجاد باس تایم ساختار چون بعد از باس منتظر آغاز پولبک جدید هستیم.

تارگت:

تارگت سوینگ لو/های ضعیف تایم میانی و بعد سوینگ های/لو تایم ساختار است

فاز ۲ (پایان پولبک ٤اچ: در جهت ٤ اچ و خلاف ۱۵م)

تعریف:

فاز ۲ هنگامی است که انتظار داریم پولبک تایم ساختار به پایان برسد و نشانه‌های اولیه پایان پولبک را مشاهده کردیم. یعنی پولبک تایم ساختار قیمت را به یک اردربلاک معتبر در منطقه دیسکانت یا اکستریم سوینگ تایم ساختار رسانده است. به طوری که انتظار پایان پولبک تایم ساختار را در آن منطقه داریم. بنابراین بهترین زمان برای ترید بر اساس فاز ۲ این است که قیمت در منطقه اکستریم باشد یا در منطقه دیسکانت و روی اردربلاکی باشد که از نظر اعتبار و قدرت شرایط پایان دادن به پولبک را دارد. ولی وقتی هنوز قیمت به اکستریم نرسیده همیشه احتمال این که تغییر روند صرفا برای بردن قیمت به ناحیه عرضه تایم میانی باشد تا از آنجا پولبک تا منطقه اکستریم تایم ساختار ادامه پیدا کند وجود دارد.

هدف:

رساندن قیمت به اولین ناحیه عرضه/تقاضای تایم میانی و سپس های/لو تایم ساختار بنابراین در تعیین تی‌پی ها همیشه اولین ناحیه عرضه/تقاضای تایم میانی را هم در نظر می‌گیریم.

الزامات:

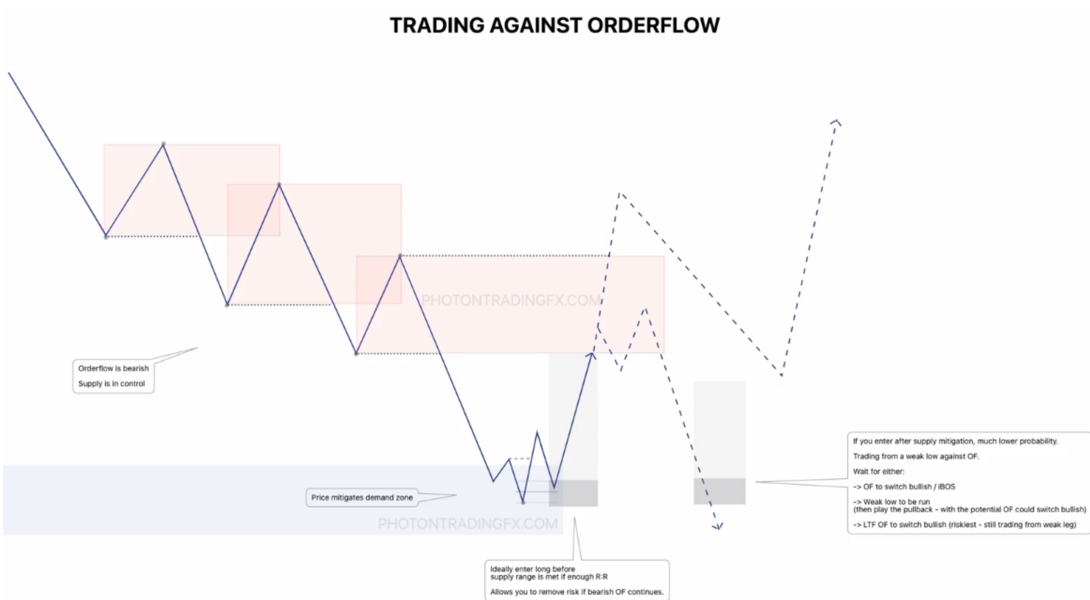
ورود در منطقه دیسکانت/اکستریم سوینگ تایم ساختار بعد از شکل گیری چاک در تایم فریم میانی (۱۵ مین)

در صورتی که قیمت به منطقه اکستریم رسیده باشد و ریفاین ۱۵ مین را هم میت کرده باشد برای ورود بر اساس فاز ب ریسک کمتری داریم بنابراین می‌توان

ورودهای اگرسیو تر داشت (مثلا مستقیم به تایم ورود برویم و یـا اینکـه ریواردهـای بزرگتری را بعنوان تی پی در نظر بگیریم)

بهتر است چاک تایم میانی + چاک تایم پایین هر دو در نظر گرفته شـود. مخصوصـا هنگامی که قیمت صرفا به منطقه دیسکانت رسیده و هنوز به اکستریم نرسیده است.

در صورتی که قیمت صرفا به دیسکانت رسیده اگر بعد چاک به ناحیـه عرضه/تقاضـا مخالف تایم میانی رسید و برگشت دیگر ورود به پوزیشن منطقی نیست. چون ممکن است پولبک تایم ساختار بخواهد ادامه پیدا کند. در مواردی که قیمـت بـه اکسـتریم تایم ساختار رسیده هم اگر قیمت بعد چاک به ناحیه عرضه/تقاضا مخالف تایم میـانی رسیده و برگشته می‌توان احتیاط کرد و منتظر شد اولین آیباس زده شـده و فـاز ۱ را ترید کرد:



اگر ساختار شکل گرفته در تایم ساختار نشانه‌هایی از تغییر روند تایم ساختار دارد بهتر است صبر کنیم اولین آیباس تایم میانی زده شود و فاز ۱ را ترید کنیم. مثلا: سـاختار تایم‌های بالاتر طوری است که انتظار می‌رود روند تایم ساختار تغییر کند. مثلا اگر در شماتیک زیر خط پررنگ ساختار هفتگی یا ماهانـه باشـد و خـط کمرنـگ سـاختار ۴ ساعته باشد که تایم‌فریم ساختار ماست، احتمال تغییر روند ۴ ساعته هست:



ورود در فاز ۲ بدون توجه به دیسکانت/پرمیوم (وقتی مومنتوم باس تایم ساختار زیـاد است):

- در مواردی که قیمت بعد شکست از خط باس (۱۵م) فاصله زیاد گرفته است
- ورود در اولین اردربلاکی که تایید بدهد
- تارگت های کوچک (سقف/کف ضعیف ۱۵م)
- شکل گیری مومنتوم در شروع روند باشد بهتر است
- مشروط بر اینکه ناحیه ساختاری/عرضه و تقاضا مهم مخالف نزدیک نیست
- مومنتوم قوی در باس نشان دهنده قوت زیاد کل اردرفو و به خصوص منطقـه اکستریم است

تارگت:

تی پی اول اولین ناحیه عرضه/تقاضا تایم میانی (۱۵ مـین) اسـت بنـابراین ورود بـه پوزیشن هنگامی منطقی است که تا آنجا ریسک به ریوارد مناسبی داشته باشید.

فاز ۳ (در جهت اردرفلوی ۱۵م و خلاف ٤ اچ)

تعریف:

فاز ۳ جایی است که قیمت در روند پولبک تایم ساختار قرار دارد. هر گاه بعد از بـاس تایم ساختار (۴ اچ) قیمت به یک اردربلاک از گذشته بازار (و همسان با تایم سـاختار به خصوص منطقه ریفاین ۱۵ داخل آن) واکنش داده و با شکل گیـری یـک آیبـاس تغییر روند داد، فاز ۳ شروع شده است.

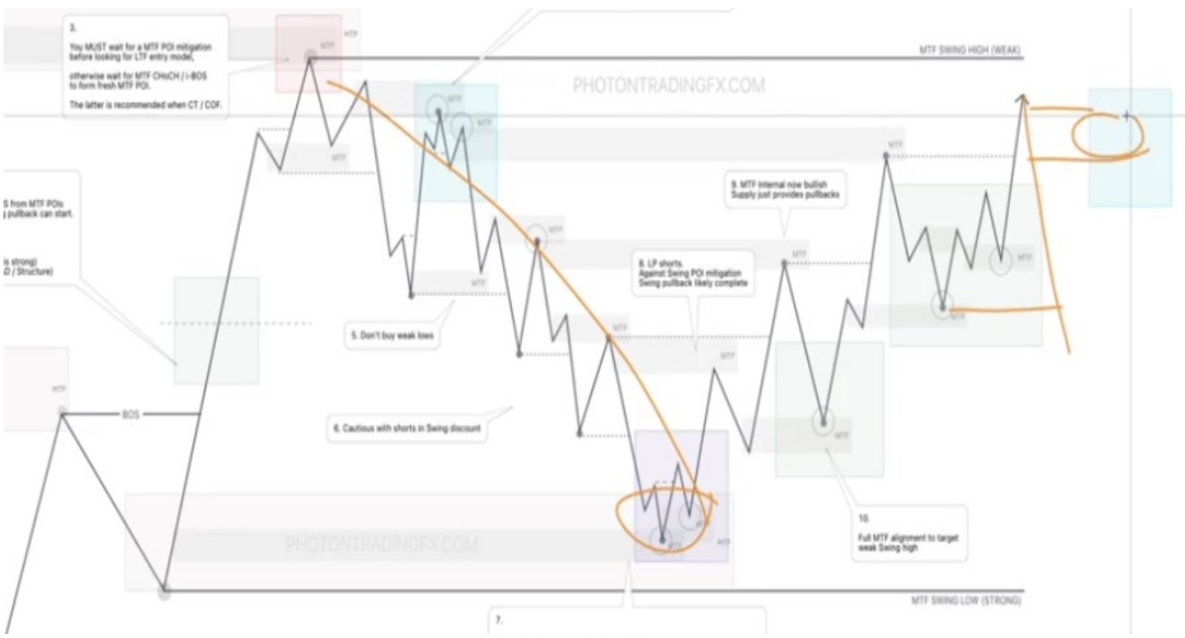
هدف:

شکل دادن به پولبک تایم ساختار و بردن قیمت به منطقه دیسکانت/اکستریم یعنی جایی که انتظار می‌رود پولبک تایم ساختار تمام شود.

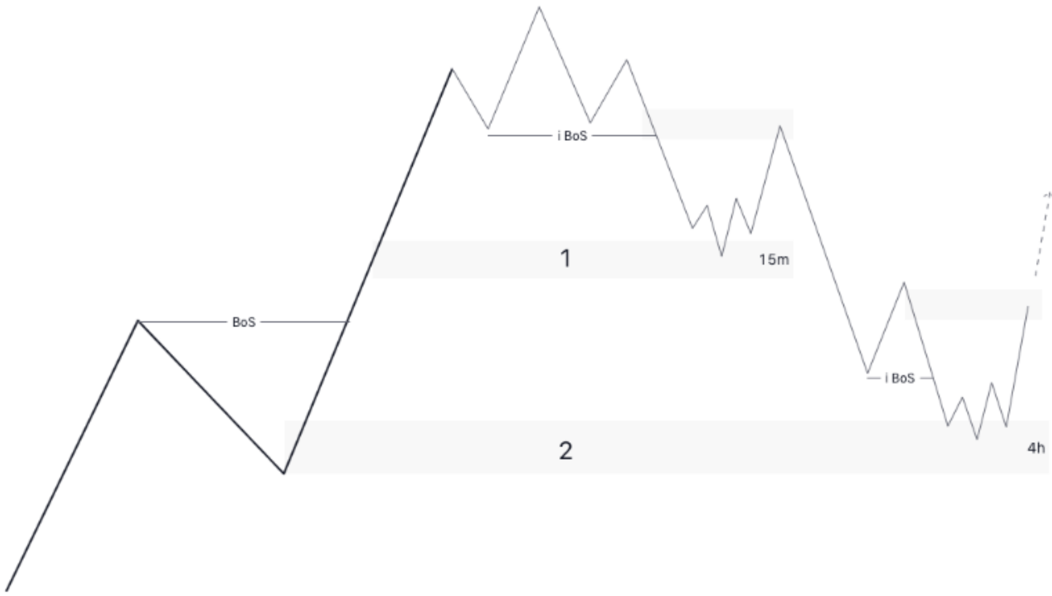
الزامات:

اگر اولین آی‌باس فاز ۳ قبل از رسیدن قیمت به یک اردربلاک معتبر از گذشته بازار زده شده باشد، در برگشت قیمت به منشا آی‌باس حتما باید چاک تایم میانی را به عنوان تایید استفاده کنیم و نمی‌توان مستقیم برای تایید به تایم پایینی رفت.

اگر قبل از باس تایم ساختار هم روند تایم میانی با یک آی‌باس تغییر کند باز هم می‌توان بر اساس فاز ۳ ترید کرد اما ریسک آن بیشتر است. مثل اینکه در شماتیک زیر بخواهیم در باکس آبی دومی وارد پوزیشن شویم:



قیمت نباید به اردربلاک معتبر در منطقه دیسکانت یا اکستریم تایم ساختار رسیده باشد. چون همیشه این سوال را باید از خود بپرسیم که قیمت در واکنش به چه ناحیه‌ای در حرکت است و هدفش کجاست. اگر واکنش به اردربلاک معتبر در منطقه دیسکانت یا اکستریم تایم ساختار باعث حرکت قیمت شده (اردربلاک ۲ در شماتیک زیر) دیگر ترید بر خلاف آن منطقی نیست. ولی اگر واکنش به یک اردربلاک تایم میانی باعث حرکت قیمت بوده (اردربلاک ۱ در شماتیک زیر) احتمالا قدرت آن تنها به اندازه ایجاد یک پولبک در تایم میانی است.



فقط در جهت اردرفلوی تایم میانی (۱۵ مین) ترید می‌کنیم و ترجیحا هیچ گاه بر خلاف روند تایم میانی (روی سقف/کف‌های ضعیف تایم میانی) ترید نمی‌کنیم. دست کم تا وقتی به انسجام و ثبات در ترید در جهت اردرفلوی تایم میانی برسیم.

امکان ورود بر اساس چاک تایم پایینی وجود دارد.

گاهی قیمت ساختار نزولی کوچک تر از آیباس میزند که در واقع نوعی رنج است نه روند و مخصوصا اگر مثل تصویر زیر در تایم آسیا باشد انتظار می‌رود در تایم فرانکفورت یا لندن نقدینگی سقف‌های این رنج سویپ شود تا همزمان عمق بیشتری از اردربلاک تایم بالا را میتیگیت کند و بعد روند نزولی را شروع کند:



تارگت:

تارگت اصلی کف/سقف ضعیف تایم میانی و تارگت نهایی نهـایی مـی‌توانـد نـواحی تقاضای معتبر در منطقه دیسکانت/اکستریم تایم ساختار باشد.

فاز ٤ (شروع پولبک ٤ اچ: خلاف ٤ اچ و ١٥م)

تعریف:

فاز ۴ جایی است که انتظار می‌رود پولبک تایم ساختار از آنجا شروع شود به این معنا که روند در تایم ساختار تغییر کند با مشاهده نشانه‌های زیر:

- بعد از باس تایم ساختار هستیم
- قیمت به یک اردربلاک مخالف از گذشته بازار واکنش داده
- شکل گیری چاک در تایم میانی

و چون: اولا همیشه برای تغییر روند نیاز به یـک آیبـاس داریـم (چـاک تغییـر رونـد نیست)، و ثانیا داریم بر خلاف روند تایم ساختار و میانی ترید می‌کنیم، ترید در فـاز ۴ بسیار پر ریسک است و توصیه نمی‌شود.

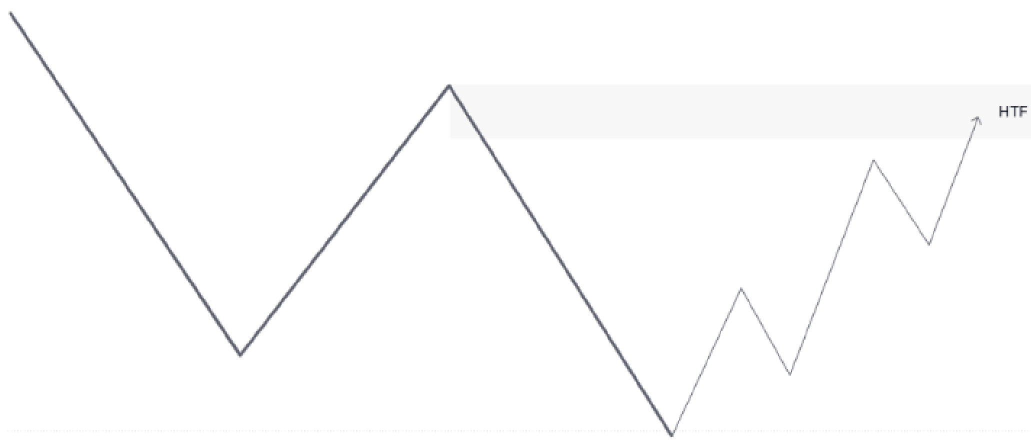
هدف:

رساندن قیمت به اولین اردربلاک مخالف تایم میانی و یا عبور قیمت از آن و شروع پولبک تا منطقه دیسکانت.

الزامات:

بعد باس و هنگام واکنش قیمت به اردربلاک مخالف (در تایم ساختار) از گذشته بازار، بهتر است قیمت اردربلاک ریفاین شده ۱۵ مین را هم درون اردربلاک مخالف تایم ساختار میتیگیت کرده باشد

بهتر است فاز ۴ را فقط در جایی ترید کنیم که در جهت ساختار تایم‌فریم‌های بالا باشد. مثلا اگر در شماتیک زیر خط پررنگ ساختار تایم‌فریم‌های بالا باشد و خط کمرنگ ساختار ۴ ساعته باشد که تایم‌فریم ساختار ماست، احتمال اینکه فاز ۴ موفقیت آمیز باشد بیشتر است:



بهتر است در فاز ۴ فقط با چاک تایم میانی (۱۵) وارد شویم به ویژه اگر قیمت هیچ اردربلاک ریفاین شده ۱۵ مین را متیتیگیت نکرده (مدل ریسکی تر این است که در صورت میتیگیت شدن اردربلاک ریفاین شده ی ۱۵ مین مستقیما به تایم ورود برویم و با مشاهده تایید وارد پوزیشن شویم)

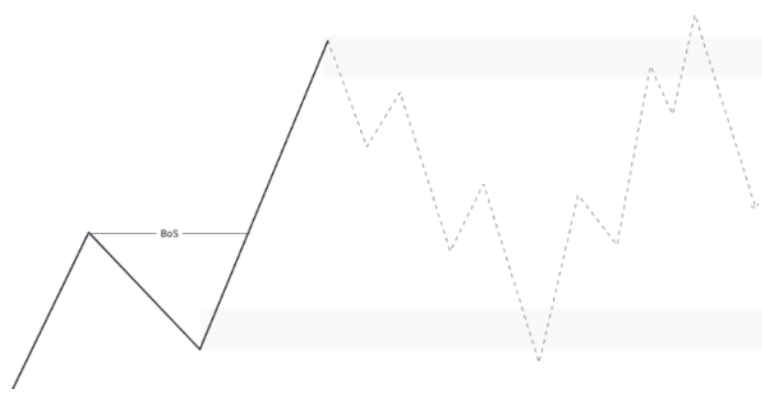
بهتر است یک مدل نقدینگی قوی را (در ۱۵ مین) برای تایید استفاده کنیم.

تارگت:

تارگت اول روی یک اردربلاک در منطقه دیسکانت/اکستریم سوینگ ۱۵م (کف/سقف قوی مخالف در تایم میانی) بنابراین خیلی مهم است که تا آنجا ریوارد منطقی داشته باشیم.

بدون فاز: ترید در رنج‌های ساید

هر گاه قیمت بر خلاف انتظار پس از پایان پولبک موفق به زدن باس جدید نمی‌شود و مخصوصا وقتی که نواحی عرضه و تقاضای اکستریم را از دو طرف سویپ می‌کنـد تشخیص روند قیمت مشکل است. بنابراین نمی‌توان تشخیص داد قیمت دقیقا در چه فازی قرار دارد و بر اساس آن فهمید ترید در کدام جهت کم ریسک تر است. معمولا این اتفاق زمانی می‌افتد که ساختار تایم‌های بالاتر می‌خواهد موجب تغییر روند تـایم ساختار شود.



در این مواقع می‌توانید از ترید خودداری کنید تا ناحیه رنج از یک طرف بشـکند. گـاه می‌توان با توجه به مومنتوم و ساختار متوجه شد احتمال شکست کدام ناحیـه بیشـتر است.

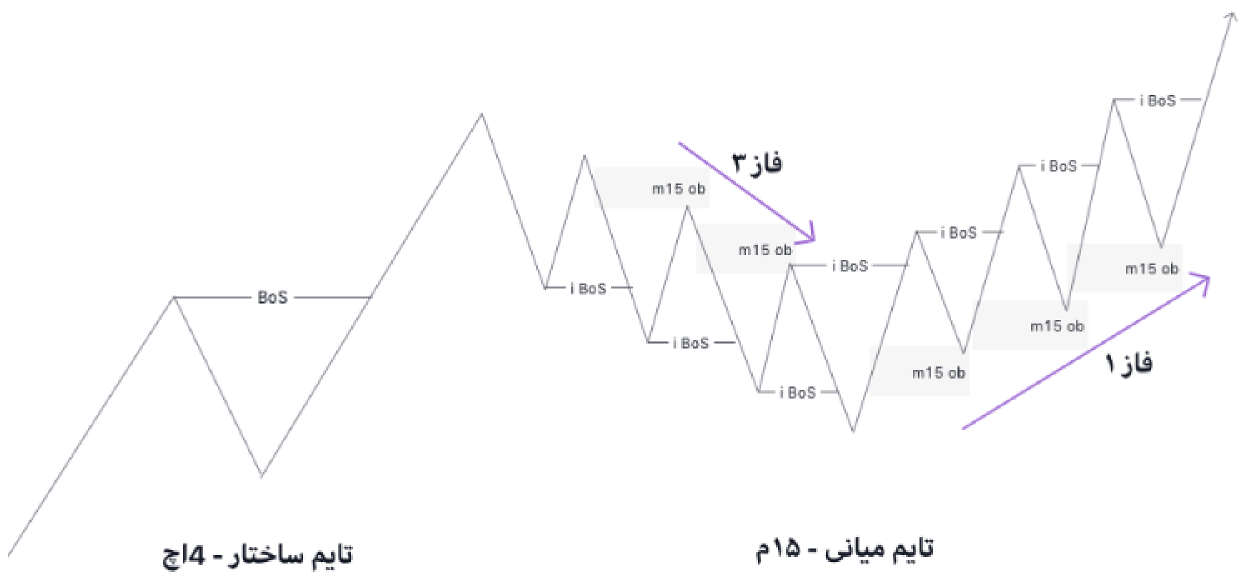
در هر صورت، از ترید در میانه خودداری کنید.

در یک سوم پایینی بای و در یک سوم بالایی سل کنید.

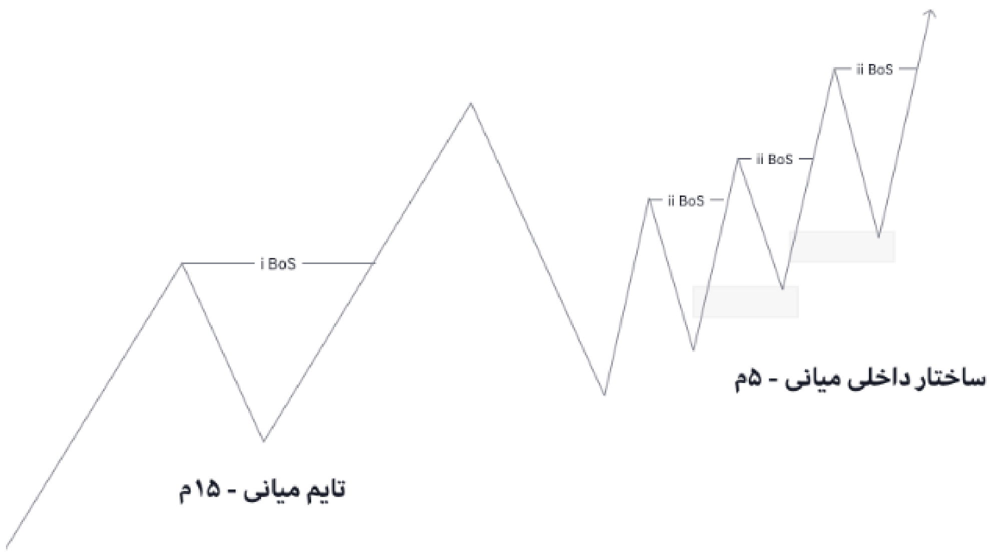
۳. انواع ورود بر اساس تایید

۱. ورود re یا ریسکی (بدون تایید):

- ورود در ob ساختار میانی یا داخلی میانی.
- بهتر است در فاز ۱ و ۳ از تایم ساختار باشد. یعنی در جهت روند تایم میانی که پولبک تایم ساختار یا سوینگ بعدی تایم ساختار را می‌سازد:



- می‌توان روی اردربلاک‌های ساختار داخلی میانی هـم تریـد کـرد مشـروط بـر اینکه در جهت روند تایم میانی باشد. یعنی اگر ساختار داخلی (۱۵ مین) را هـم فازبندی کنیم ورود ریسکی در فاز ۱ آن بهتر است:



مگر اینکه ساختار داخلی (باس ۱۵ مین) به قدری بزرگ باشد که فضای کافی را برای ترید کردن فاز ۳ ی آن هم فراهم کرده باشد.

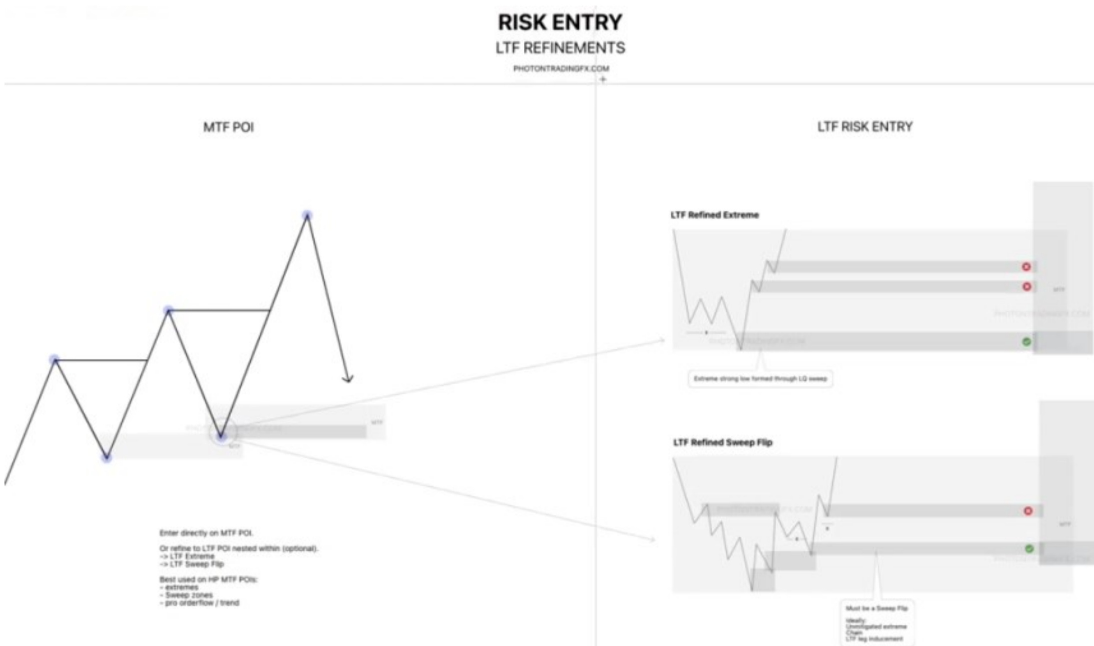
مت ساختار داخلی میانی را در همان تایم میانی (معمولا ۱۵ دقیقه) رصد می‌کند یعنی شکست باس ساختار داخلی میانی با بدنه باید در تایم ۱۵ دیده شود اما می‌توان از تایم ۵ دقیقه هم برای رصد ساختار داخلی میانی استفاده کرد.

- بهتر است در منطقه اکستریم باشد. می‌توان در صورتی که اردربلاک دسیژنال معیارهای اعتبار خوبی داشت (مثل سویپ زون، فلیپ زون، عدم تعادل، نقدینگی، فشردگی و...) روی اردربلاک دسیژنال هم وارد شد. یا روی هر دو اردربلاک دسیژنال و اکستریم لیمیت گذاشت.

برای تصمیم گیری در این باره شفاف بودن ساختار و فازبندی ها اهمیت زیادی دارد.

در نهایت بک تست‌های شخص ملاک هست.

- می توان آن را به اردربلاک های مصرف نشده و قوی تایم پایین تر ریفاین کرد. مخصوصا اگر اردربلاک ریفاین در انتهای ناحیه قرار داشته باشد یا سویپ زون باشد:



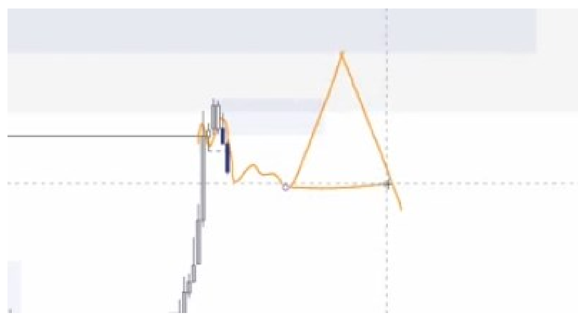
۲. ورود با تایید (ce) یا تایید دوبل (dce):

- ورود با تایید چاک تایم پایینی
- بسته به موقعیت و ساختار بهتر است بعضـی از معیارهـای چـاک قـوی را هـم داشته باشد.
- بهتر است به همراه یکی از نقدینگی های هفت گانه باشد. ولی در صورتی کـه در ناحیه باشد که امکان ورود ریسکی هست می‌توان از چاک ساده هم استفاده کرد.
- برای تایید دوبل باید بعد از چاک یک باس هم شـکل گرفتـه باشـد و ورود در منشا باس است

٤. چاک قوی/ضعیف

چاک قوی می‌تواند دارای یک یا چند مورد از ویژگی‌های زیر باشد. در صورتی که هیچ کدام از این ویژگی‌ها را ندارد چاک ضعیف تلقی می‌شود اما ضرورت ندارد همه آنها را داشته باشد. در صورتی که نسبت به تحلیل ساختار اطمینان بیشتری داریم می‌توانیم چاک ضعیف را هم مبنای ورود قرار دهیم اما بهتر است دست کم اوایل کار همیشه یک یا چند تا از این ویژگی‌ها را داشته باشد:

۱. چاک وی شیپ: اگر حرکت قیمت برای زدن آخرین کف/سقف تایم ورود با سرعت بوده و با سرعت هم برگردد مثل حالت برداشتن نقدینگی اعتبار بیشتری دارد چون نشان می‌دهد اردرهای بزرگی در آن سطح قیمتی وجود داشته که قیمت برای برداشتن آنها رفته و برگشته.



۲. انگالف: چاکی که در همان تایم یا تایم بالاتر به شکل انگالف دیده شود قوی‌تر است. کندل انگالف می‌تواند بیش از یک کندل باشد به شرطی که همه آنها کندل‌های قوی باشند. هر چند تعداد کندل بیشتری از لگ قبلی انگالف شده باشد اعتبار بیشتری دارد.

۳. اندازه شکست: اگر شکستی که موجب چاک شده با پیپ یا پیپت خیلی کم صورت گرفته باشه ضعیف است. باید قیمت کمی از خط شکست فاصله گرفته باشد. فاصله گرفتن زیاد هم که به ناحیه یا عرضه/تقاضا مخالف مهم رسیده باشد، مطلوب نیست.

۴. اگر شکست کف/سقف آخر قبل چاک هم با پیپ یا پیپت خیلی کم صورت گرفته باشه ضعیف‌تر است از حالتی که قیمت با سرعت چند پیپ را رفته و برگشته باشد.

۵. نوع شکست: اگر شکست با بدنه باشد قوی تر است.

۶. میتگیت نشدن ناحیه مخالف: اگر قیمت بعد از چاک به قدری پیش رفته باشد که به ناحیه مخالف رسیده باشد ضعیف تلقی می‌شود.

۶. کف/سقف پیووتی: اگر شکستی که موجب چاک شده یک ساختار پیووتی قابل توجه را شکسته باشد نه یک سقف/کف کندلی قوی‌تر است و سقف/کف کندلی هم از سقف/کف ناشی از اینسایدبار قوی‌تر است. به طور کلی بهتر از از اینسایدبار استفاده نشود. مخصوصا اگر سقف/کف فرکتال یا تک کندلی شکسته شود و کمی جلوتر قیمت به سقف/کف پیووتی برسد و طبیعتا اگر ساختار پیووتی و روند جاری بخواهد کار کند چاک ما فیل خواهد شد.

The price must break a significant piece of structure

مثال از ریکپ:

در مثال زیر چاک اول روی اردربلاک زده شده است. اگر بخواهیم طبق مدل‌های ورود وارد شویم: چون نقدینگی دیگری نداشتیم باید منتظر باشیم چاک دوم هم زده شود تا طبق مدل نقدینگی 2A وارد شویم.

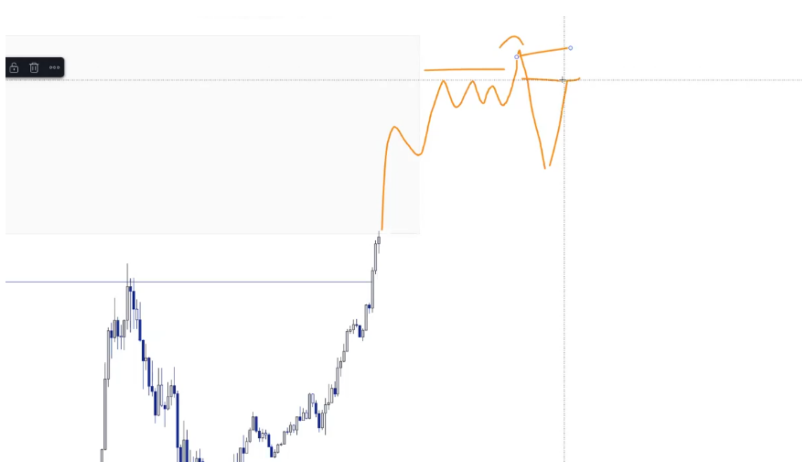
اما همین چاک اول چون با یک پیپ زده شده است ضعیف است پس مدل نقدینگی آن هم ضعیف خواهد بود. از طرفی در اینجا کفی که شکست ش باعث چاک شده یک کف کندلی است. (های این کندل با های کندل قبلی ش برابر است و همین کافی است لازم نیست لزوما پایین تر باشد ولی اگ بالاتر بود ینی هم های و هم لو کندل قبل را زده بود نمیشد لو آن را کف حساب کرد):



برای همین در لگ بعدی وقتی می‌خواهیم چاک بعدی را رصد کنیم نمی‌توانیم کـف بالایی را چاک و پی.بی.ال بگیریم چون هم های و هم لوی کندل قبـل ش را زده و مجبوریم زده شدن کف پیووتی را چاک بگیریم. ضمن اینکه با توجه به ساختاری که شکل گرفته شکست کف پیووتی اهمیت دارد:



۷. سویپ رنج آسیا: در صورتی که میخاهیم شروع پولبک تایم ساختار را تریـد کنـیم هر گاه سقف/کف یک رنج که نقدینگی خوب ساخته ترجیحا رنج آسـیا وقتـی مثـل تصویر زیر نقدینگی سقف‌های آن سویپ می‌شـود همزمـان یـک اردربـلاک معتبـر میتیگیت میشود و قیمت به صورت وی شیپ بر می‌گردد و کف اخر را می‌شکند این چاک خیلی معتبر است (دقیقه ۲۵ وبینار مربوط به ریکپ ۱۳ جون ۲۰۲۳):



۸. شکست خط روند: اگر چاک همراه با شکست خط روند همراه باشد تایید قوی‌تری داریم به ویژه وقتی اپروچ قیمت به اردربلاک با فشردگی مثل تری درایو بوده.

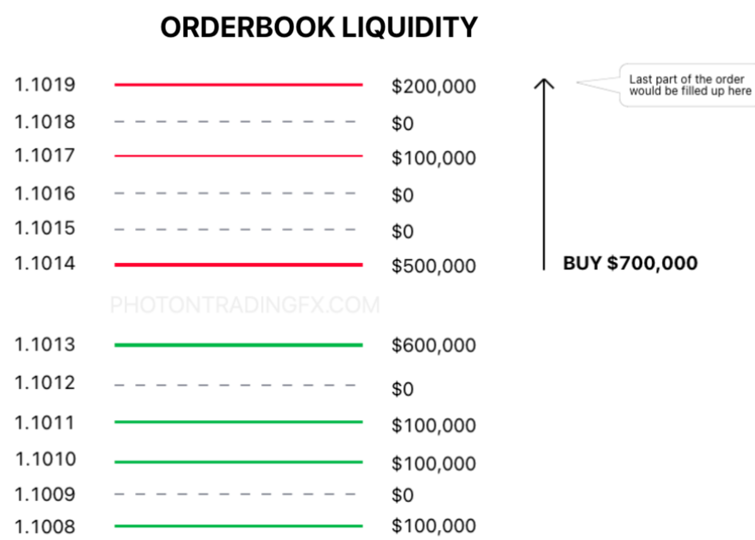
نکته: برای تایید اضافه اردربلاک هم می‌توان از تناظر اردربلاک/برکربلاک و برخورد با خط روند به ویژه در برخورد سوم استفاده کرد.

برای ترسیم خط روند از کف/سقف‌هایی استفاده می‌کنیم که باعث شکست ساختار شده‌اند.

۵. نقدینگی و مدل‌های ورود بر اساس نقدینگی

نقدینگی

نقدینگی در بازار به معنای میزان تقاضا و عرضه در یک سطح معین از قیمت است. هر چه عرضه/تقاضای بیشتری در یک سطح معین از قیمت بخواهد وارد بازار شود، حجم بیشتری از نقدینگی برای حرکت قیمت لازم است. زیرا معادل هر سفارش خرید، باید یک سفارش فروش وجود داشته باشد و برعکس تا بازار متعادل باقی بماند.



https://s3.tradingview.com/snapshots/9/990bGCyU.png

به همین دلیل قیمت به طور مداوم به دنبال استخرهای نقدینگی (اردرها) برای ایجاد تعادل در بازار است و تحلیل ساختار شامل یافتن استخرهای نقدینگی نیز می‌شود.

پس تحلیل نمودار به معنای بکارگیری چارچوبی مشخص برای پی بردن به اردرهای بزرگ از طریق یافتن نشانه‌های آن در بازار شامل سه سطح ذیل است:

۱. ساختار بازار: مشخص کردن داستان قیمت در تایم ساختار و تـایم میـانی، تعیـین جهت روند (صعودی / نزولی)، تعیین سطح مناسب (منطقه ارزان/گران).

۲. مناطق عرضه/تقاضا: نواحی که جایی کـه اردرهـای بـزرگ وارد بـازار شـده‌انـد و ممکن است اردرهای باقی‌مانده ناشی از فعالیت بانک‌ها و موسسات مـالی بـزرگ در آن وجود داشته باشد.

۳. مفاهیم نقدینگی: نشانه‌هایی که نواحی که استخرهای نقدینگی را نشان می‌دهد.

وجود نقدینگی در یک سطح قیمتی مشخص می‌تواند به عنـوان یـک آهنربـا بـرای جذب قیمت عمل کند، زیرا بازار به دنبال نقـدینگی بـرای متعـادل کـردن مجـدد و تقویت حرکت‌های بیشتر است. می‌توان از این ابزار برای پیش‌بینی جایی کـه جـذب نقدینگی بعدی ممکن است اتفاق بیفتد استفاده کرد تا مشخص کـرد قیمـت ممکـن است کدام سطح قیمت را هدف قرار دهد.

دو نوع سطح مبتنی بر نقدینگی در بازار می‌توان رصد کرد:

۱. نواحی که نقدینگی در آنها خوابیده است (ایندوسمنت): دلالت مـی‌کنـد بـر اینکـه اردرای بزرگ احتمالا در چه نواحی وارد بازار خواهند شد.

۲. نواحی که قبل از حرکت قیمت از آنها نقـدینگی زده شـده (سـویپ زون): دلالـت می‌کند بر اینکه اردرهای بزرگ احتمالا در چه نواحی وارد بازار شده اسـت و توضـیح آن در فصل یک ذیل بحث اردربلاک‌ها آمد.

ایندوسمنت

فرض این است که پشت هر سقف یا کف ساختاری در بازار نقدینگی وجود دارد. هـر چه ساختار مهم‌تر باشد، احتمالا نقدینگی بیشتری پشت سقف یا کف آن وجـود دارد. نقدینگی این نواحی می‌تواند بانـک‌هـای و موسسـات مـالی را بـرای عملـی کـردن اردرهای بزرگ در این سطوح قیمتی جذب کند. بر اساس این کـه سـطوح نقـدینگی مذکور سقف باشد یا کف به آن بای‌ساید لیکوییدیتی یا سل‌سـاید لیکوییـدیتی گفتـه می‌شود:

باس‌ساید لیکوییدیتی (BSLQ): نقدینگی موجود پشت سقف‌ها

سل‌ساید لیکوییدیتی (SSLQ): نقدینگی موجود پشت کف‌ها

هر سفارش خرید باید یک سفارش فروش معادل داشته باشد تا یـک معاملـه انجـام شود (برعکس). به همین دلیل عملی شدن اردرهای بزرگ با حداقل اسلیپج نیـاز بـه مقدار زیادی از عرضه/تقاضا در جهت مخالف دارد. همان طور که گفتـه شـد گـاهی بانک‌ها برای پیدا کردن عرضه/تقاضای مخالف برای اجرای اردرهای بـزرگ خـود از نقدینگی سقف/کف‌ها استفاده می‌کنند.

به سقف‌ها و کف‌هایی که بانک‌هـا و موسسـات بـزرگ احتمـالا از آنهـا بـه عنـوان نقدینگی استفاده می‌کنند نواحی ایندوسمنت گفته می‌شـود. ایندوسـمنت بـه معنـای ترغیب و وادار کردن کسی به انجام امری است.

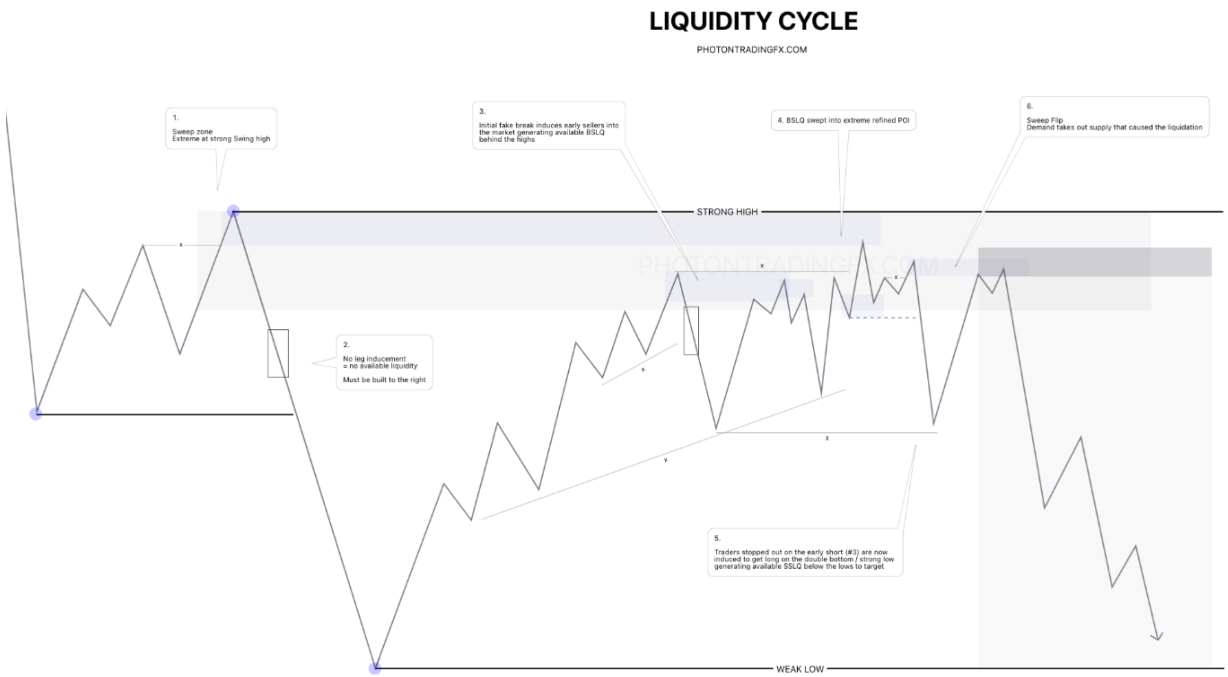
این امر به طور خاص درباره الگوهای نموداری مانند سقف دوقلو و... مطرح می‌شـود. یعنی الگوهای نموداری، معامله‌گران بازار را به انجام معاملات خود در سـطوح معـین ترغیب یا وادار (ایندوس) می‌کند.



https://s3.tradingview.com/snapshots/9/990bGCyU.png

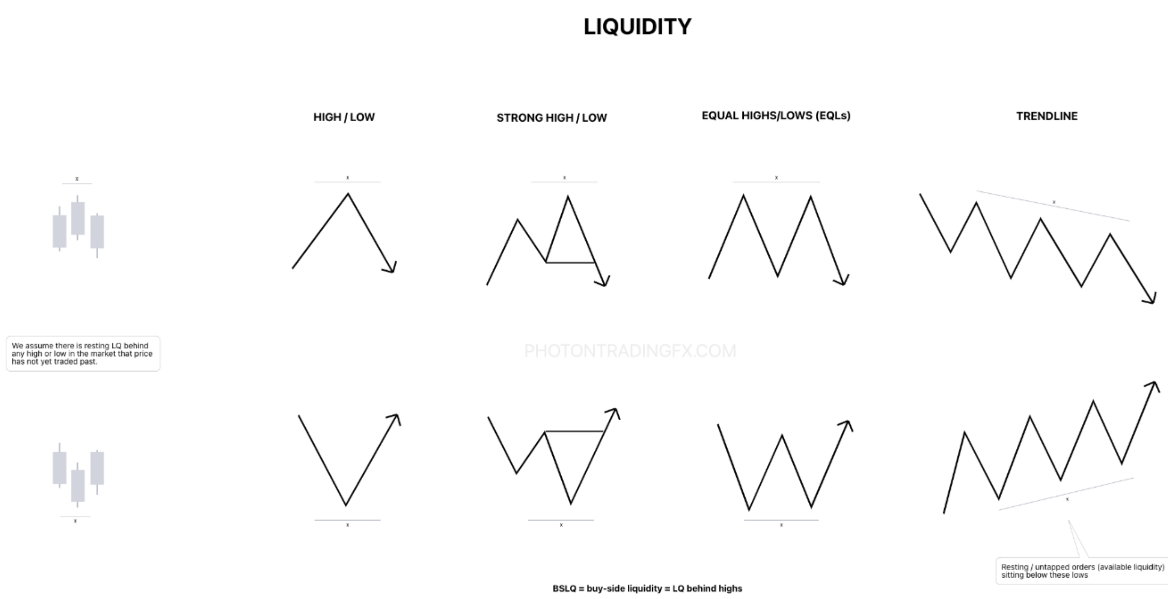
این امر باعث ایجاد نقدینگی برای اردرهای بزرگ می‌شود و بانک‌هـا از آن اسـتفاده می‌کنند. بنابراین بانک‌ها از نقدینگی طرف مخالف خـود بـرای گـرفتن پوزیشـن در سمت دیگر استفاده می‌کنند.

چون حرکت قیمت روی نمودار به حجم بسیار زیادی نقدینگی در دو طـرف خریـد و فروش نیاز دارد، در واقع مجموعه‌ای از انواع نقدینگی در لگ راسـت و چـپ حرکـت قیمت در نمودار را ممکن می‌کند که به آن چرخه نقدینگی گفته می‌شود:



https://s3.tradingview.com/snapshots/f/fRxR6NGu.png

وجود ایندوسمنت (که دلالت بر وجود نقدینگی می‌کند) پیش از یک ناحیه (اردربلاک) ـ چه در لگ چپ و چه در لگ راست ـ می‌تواند احتمال کار کردن آن اردربلاک را افزایش دهد، زیرا این شرایط احتمالا دخالت بانک‌ها و اردرهای بزرگ را افزایش می‌دهد.



https://s3.tradingview.com/snapshots/y/YIR9dzpO.png

با توجه به آنچه گفته شد می‌توان سه مفهوم ذیل را از هم متمایز کرد:

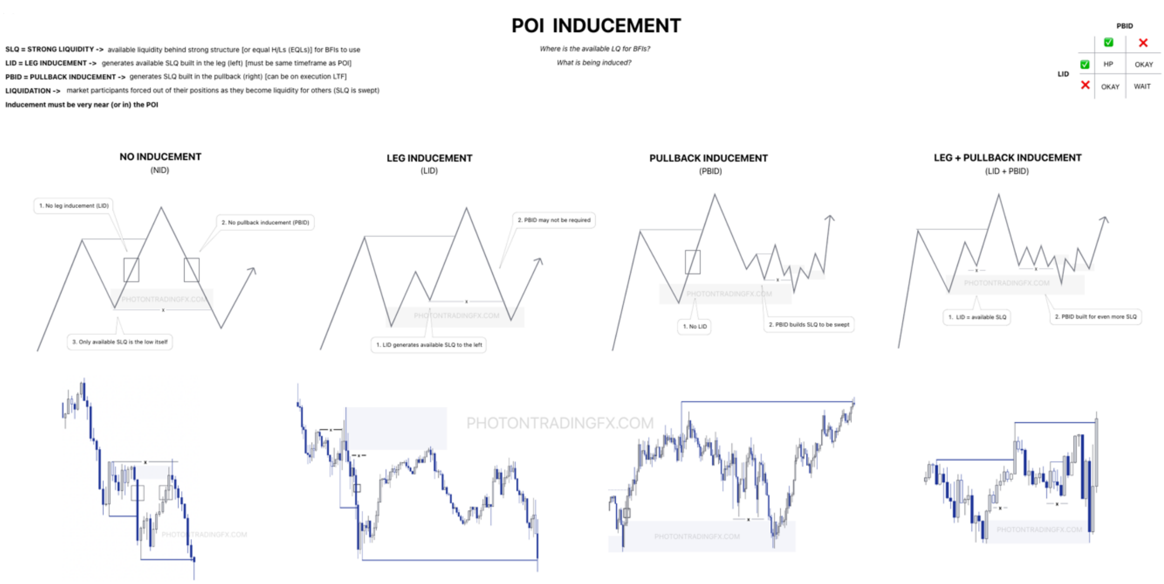
نقدینگی موجود: اردرهای ناشی از سطوح و سقف/کف‌ها مهم در نمـودار کـه محـل قرارگیری استاپ‌های زیادی است.

ایندوسمنت: سطحی از قیمت که معامله‌گران را ترغیب می‌کند با جهت‌گیری مخالف استاپ خود را در سطوح نقدینگی قرار دهند.

لیکوییدیشن (زده شدن نقدینگی): خارج کردن معامله‌گران از بازار به دلیل جمع‌آوری اردرهای ناشی از استاپ‌های آنها.

نقدینگی یا ایندوسمنت را می‌توان به دو دسته نقدینگی لگ چـپ (lid) و نقـدینگی لگ راست یا پولبک (pbid) تقسیم کرد. نقدینگی لگ چپ حتما باید در تایم تحلیل دیده شود اما نقدینگی پولبک را می‌تـوان در تـایم ورود هـم رصـد کـرد. اگـر یـک اردربلاک یکی از این دو مدل نقدینگی را داشته باشد کافی است امـا وجـود هـر دو برای یک اردربلاک به اعتبار آن اضافه می‌کند.

همچنین می‌توان نقدینگی را به دو نوع نقدینگی عادی و نقدینگی قـوی (slq) هـم تقسیم کرد. نقدینگی قوی نقـدینگی اسـت کـه پشـت سـقف/کف‌هـای ایکـوال یـا سقف/کف‌های قوی وجود دارد. هر کدام از انواع نقدینگی بایـد نزدیـک (یـا داخـل) اردربلاک باشند و فاصله زیادی از آن نداشته باشند.



https://s3.tradingview.com/snapshots/p/p96XYslW.png

مدل‌های ورود مبتنی بر نقدینگی

اگر به تازگی می‌خواهید شروع به ترید کنید، ابتـدا از کـم ریسـک تـرین مـدل ورود شروع کنید و فقط همان را ترید کنید و تا وقتی به مهارت در آن نرسیدید مدل بعدی را ترید نکنید.

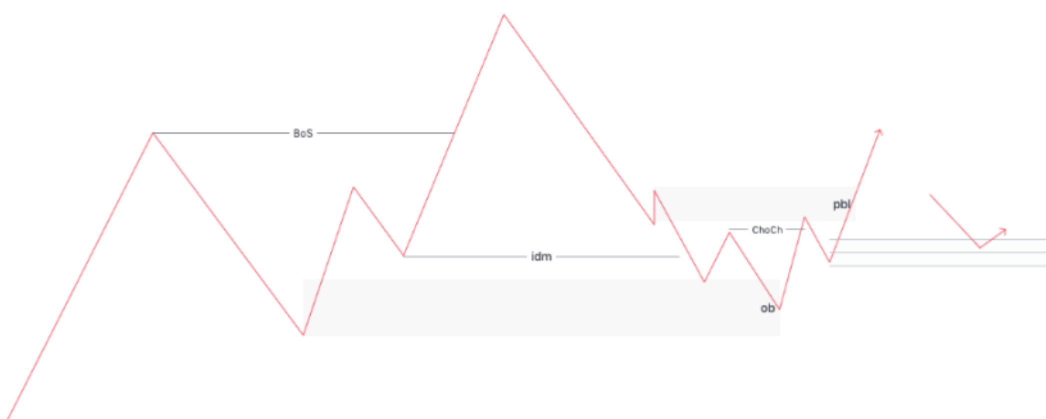
طرح کلی درباره نقدینگی:

۱. آیا در ناحیه فیلیپ دو کف و سویپ شدن کف اول داریم:

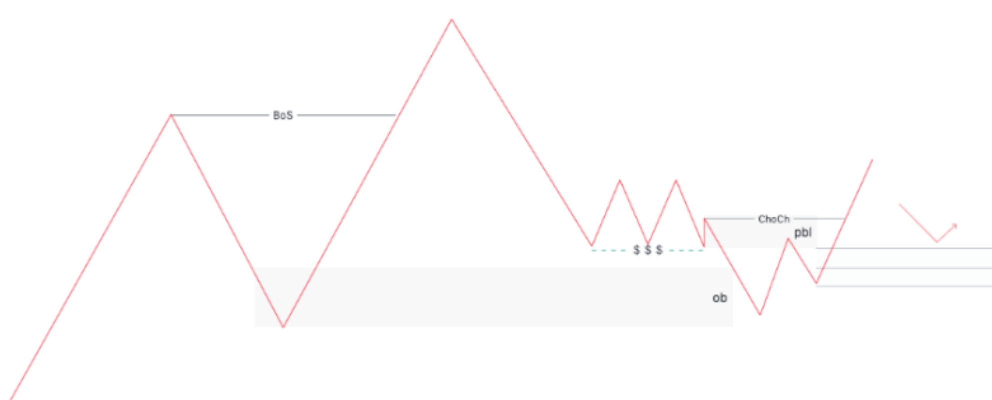
بله: ورود در فلیپ

خیر: آیا نقدینگی چپ **در تایم تحلیل** وجود دارد؟

بله: ورود در فلیپ/اکستریم بعد از سویپ نقدینگی لگ چپ و زدن pbl



خیر: منتظر شکل گیری یک نقدینگی قوی در لگ راست (لگ پولبـک) هسـتیم (در تایم ورود) + سویپ نقدینگی و ورود در فلیپ/اکستریم



مواردی که پاسخ همه سوالات بالا مثبت باشد مواردی با احتمال موفقیت بالا (HP) است:

pbid

		+	*
lid	+	HP	OK
	*	OK	wait

نشانه موثر بودن نقدینگی (pbl)

هر نقدینگی در صورتی اعتبار دارد که اردربلاک منشا سویپ شدن نقدینگی (pont before liq.=pbl) فیل شود.

یعنی اردربلاکی که منشا شکست سطحی است که به عنوان نقدینگی در نظر گرفته‌ایم: دقیقا اولین اردربلاک قبل از شکست سطح نقدینگی.

اردربلاک پی.بی.ال هر وقت بشکند علامت این هست که نقدینگی مورد نظر برای ریورس قیمت مورد استفاده قرار گرفته است. بنابراین تنها در این صورت می‌توان بر اساس اون نقدینگی ترید کرد.

به طور اگرسیو می‌توان اولین اردربلاک مخفی رو به عنوان pbl تعیین کرد یا مثل شکل زیر میتونه آخرین حرکت b2s مینور باشه. در تصویر زیر خط افقی کمرنگ مربوط به نقدینگی ایندوسمنت لگ چپ است که قیمت از آن رد شده است. در این مثال سایه بای تو سل دو کندل آخر به عنوان پی.بی.ال علامت زده شده:



به طور کلی pbl را می‌توان بر اساس اعتبارش به سه نوع تقسیم کرد:

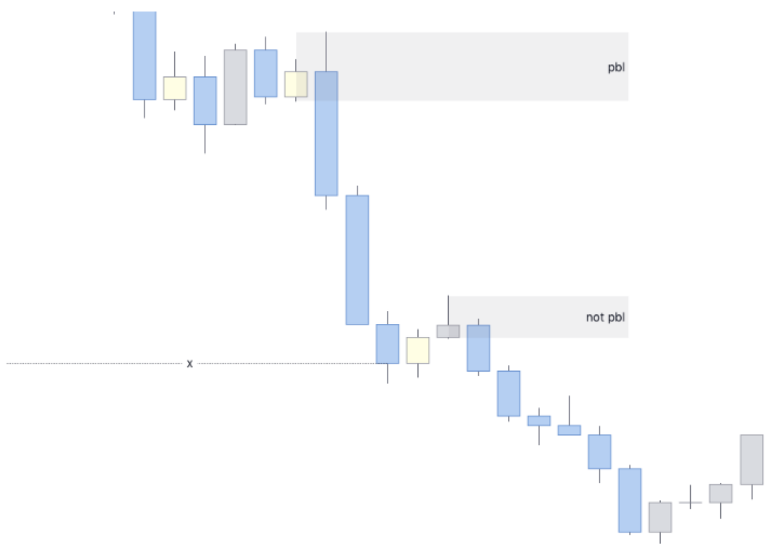
۱. سایه های بای تو سل یا سل تو بای،

۲. کندلهای داجی میانه ی لگ،

۳. اردربلاکی ک با سقف و کف کندلی یا پیووتی تشکیل شده باشه

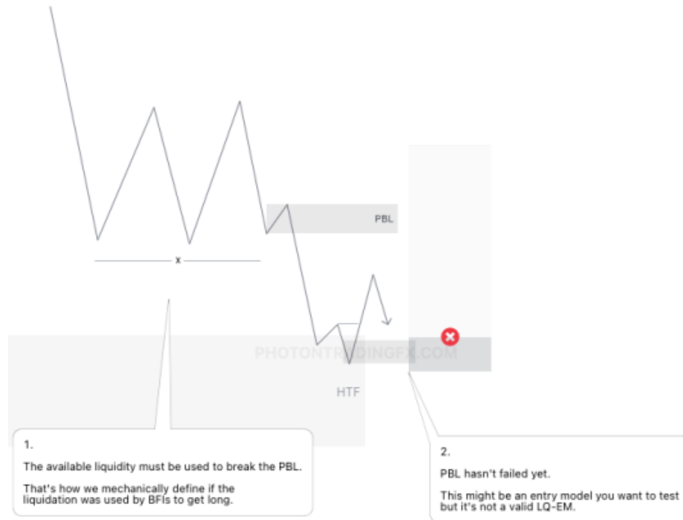
از این سه نوع اولی ریسک بالایی دارد دومی ریسک متوسط و سومی مطمئن ترین است. چون دو تای اول با تسامح منشا زده شدن نقدینگی تلقی می شوند. منشا اصلی برای زده شدن یک سطح ینی جایی که تصمیم اصلی برای شکست در آنجا انجام شده و تصمیم در اصل روی اردربلاک‌های پیووتی گرفته می‌شود. بنابراین مخصوصا هر وقت در تحلیل ساختار ابهام داشتیم باید از نوع سوم استفاده کنیم.

اردربلاک پی.بی.ال باید کاملا قبل از سطح نقدینگی باشد اگ سایه ش از سطح عبور کرده منشا شکست نیست چون در واقع آخرین حرکت b2s بعد از شکست رخ داده در این موارد باید بریم یک اردربلاک قبل رو به عنوان pbl بگیریم:

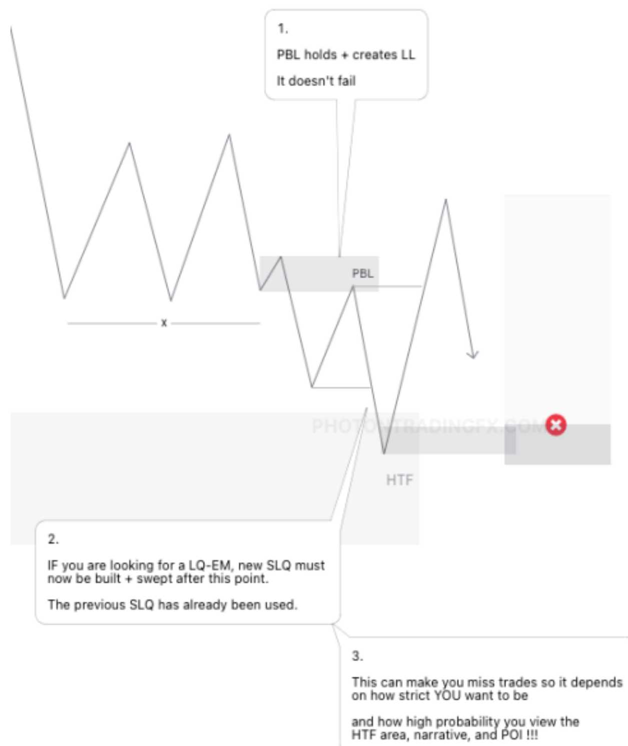


اشتباهات احتمالی درباره pbl

۱. چاک شکل گرفته ولی هنوز pbl فیل نشده

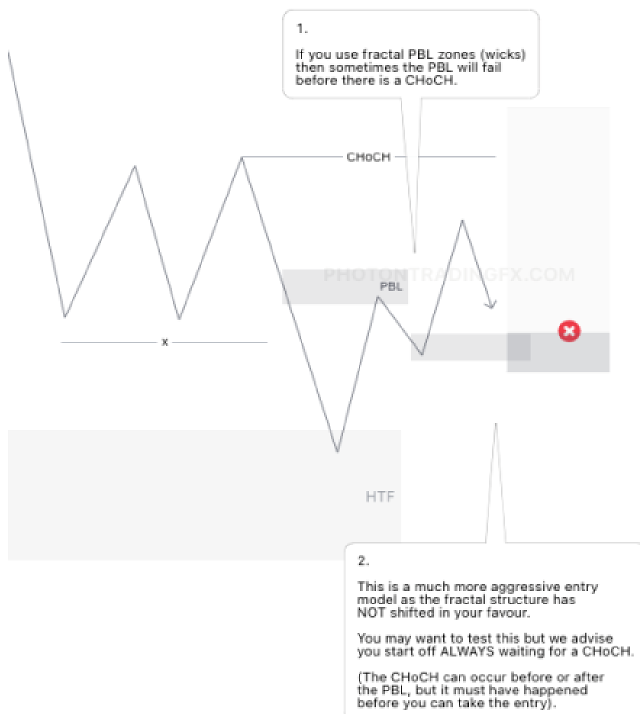


۲. به جای اینکه اردربلاک pbl شکسته شود میتیگیت شـده و موجـب بـاس شـده باشد:





۳. بعد یا هنگام فیل شدن pbl تایید چاک نداده



مدل‌های پنج‌گانه ورود

در تایید گرفتن از طریق choch در تایم ورود، بهتر است در هنگام شکست سطح choch واکنشی فلیپ سویپ دار را ببینیم زیرا به این معناست که ناحیه شکسته شده از نظر سفارشات مهم بوده و شکست آن اعتبار دارد. در صورتی که فیلیپی که

داریم فق یک کف دارد یا سویپ معتبری ندارد یکی از مدل های نقدینگی زیر می‌تواند این ضعف را برای ورود در فلیپ جبران کند.

* در تمام موارد اگر فلیپ نداشتیم ورود در اکستریم خواهد بود.

ترتیب این مدل ها در مواردی که نقدینگی چپ (نقدینگی لگ چپ یا lid) نداریم (مدل ۲ به بعد) بر اساس میزان اعتبار: به ترتیب شماره ۲ سپس ۳و۴ و سپس ۵ است.

مدل 1 (نقدینگی لگ چپ)

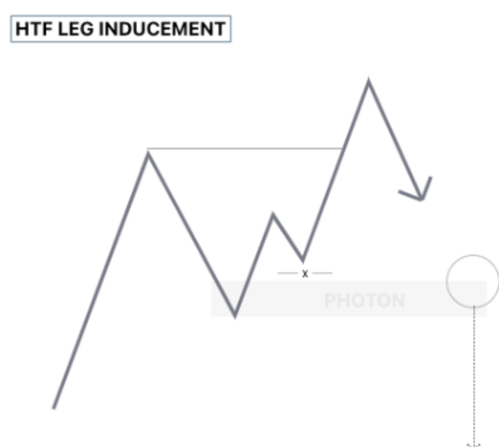
۱ـ نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) داریم

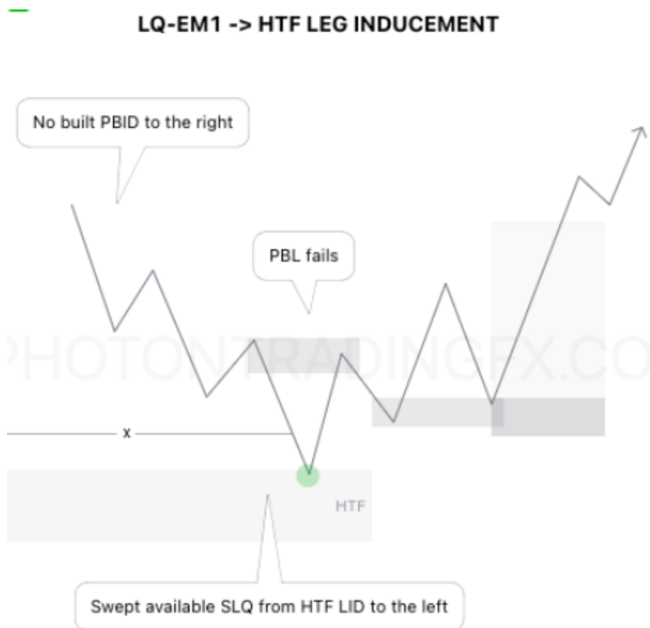
۲ـ نقدینگی راست (نقدینگی پولبک یا pbid) نداریم

۳ـ قیمت در تایم تحلیل یک نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) را "که به اردربلاک نزدیک بوده" زده (اگر دور بود هم میشه ولی باید pbl مربوط به همان نقدینگی زده بشه تا بشه گفت نقدینگی عمل کرده)

۴- زدن pbl و چاک

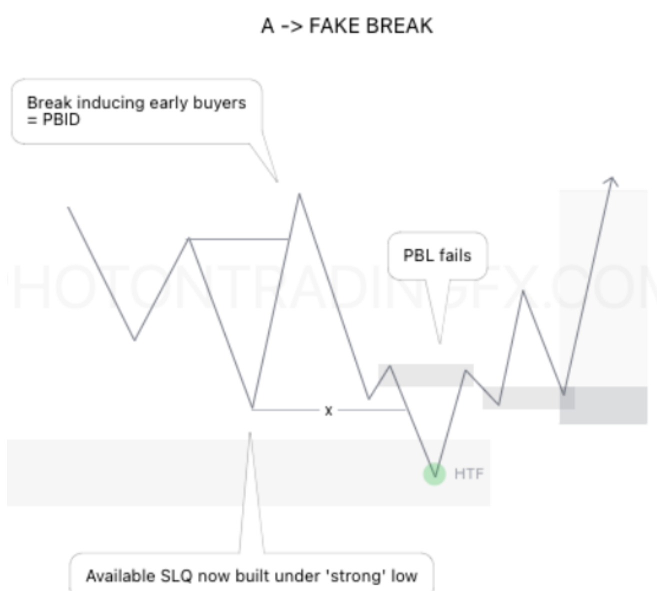
= امکان ورود در فلیپ ساده (بدون سویپ)





https://s3.tradingview.com/snapshots/x/XEvrV8O1.png

مدل 2A (چاک فیک)



۱ـ نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) نداریم

۲ـ نقدینگی آخرین سقف ساختار داخلی زده شده

۳ـ شکست یا زدن نقدینگی کف قوی ای که در اثر حرکت فوق ایجاد شده (به عنوان pbid)

۴- زدن pbl و چاک

= امکان ورود در فلیپ ساده (بدون سویپ)

نکته: هر چه چاک اول معیارهای اعتبار و قدرت بیشتری داشته باشد نقدینگی مدل 2A قوی تر است.

در صورتی که کف قوی شکل گرفته در اثر چاک اول بشکند ولی حرکت قیمت شباهتی به سویپ نقدینگی نداشته باشه یا بعد از سویپ قیمت به زدن ساختار نزولی ادامه دهد یا مدل ورود بی‌اعتبار یا به شدت ضعیف است:



مدل 2B (نقدینگی ایکوال)

۱ـ نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) نداریم

۲ـ نقدینگی دو کف (به عنوان pbid) در محل آخرین کف

۳ـ زدن pbl و چاک

۳ـ ورود در فلیپ ساده (بدون سویپ)

B -> EQLs



نکته:

۱. هر چه کف/سقف‌های ایکوال بزرگ‌تر و عمیق تر باشد یا تعداد کف/سقف بیشتر باشد مدل نقدینگی ایکوال قوی‌تری داریم. مخصوصا اگر مربوط به رنج آسیا باشد.

در مثال زیر مدرس به خاطر تعداد کف‌ها مدل نقدینگی را قوی دانسته است:



۲. هر چه قیمت بعد از شکست ایکوال از آن بیشتر فاصله گرفته باشد نقدینگی ایکوال ضعیف‌تری داریم. با پیپ یا پیپت خیلی کم هم ضعیف است. باید به لحاظ مومنتوم و اندازه سویپ نقدینگی را نشان دهد.



مدل 3A (ورود در اکستریم)



۱ـ نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) نداریم

۲ـ نقدینگی راست (نقدینگی پولبک یا pbid) نداریم

۳ـ فلیپ بدون سویپ داریم که ممکن است تبدیل بـه idm بـرای اکسـتریم شـود (بنابراین چون نقدینگی چپ و راست نداریم فیل شدن فلیپ را در صورت وقـوع بـه عنوان نقدینگی تلقی می‌کنیم)

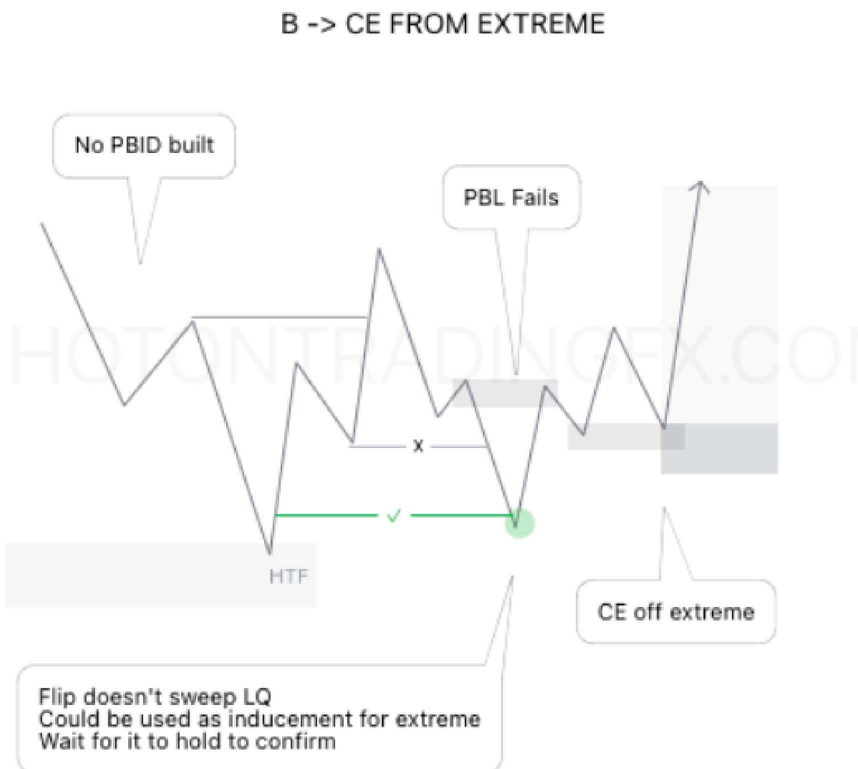
۴ـ قیمت قبل شکست فلیپ واکنش جزیی می‌دهد (pbl) و بعد از شکست فلیپ بـه اکستریم واکنش می دهد

۵ـ بعد از واکنش بر می‌گردد و اردربلاک pbl (منشا شکسـت فلیـپ) را بـا واکـنش جزیی چاک میکند. بنابراین یک ناحیه فلیپ جدید شکل گرفته که اردربلاک مناسبی برای ورود است

۶ـ در صورتی که شرط سوم وجود نداشت صبر میکنیم تا اگر اکستریم را سویپ کرد آن را به عنوان نقدینگی تلقی مـی کنـیم و در ایـن صـورت طبـق مـدل 2A ورود می‌کنیم

این مدل ورود با تایید اضافه (ce) است ولـی امکـان ورود مسـتقیم در اکسـتریم بـا پذیرش ریسک بالاتر وجود دارد مخصوصا وقتـی چـاک مـورد نظـر در داخـل یـک اردربلاک قوی شکل گرفته که فکـر مـی‌کنیـد ارزش ریسـک کـردن را دارد. مـثلا اردربلاک اکستریم تـایم سـاختار از اردربـلاک ابتـدای ناحیـه ی دیسـکانت قـدرت بیشتری دارد [یا در مواقعی که مومنتوم بالایی بعد از اردربلاک تـایم سـاختار شـکل گرفته]

مدل **3B** (ورود با تایید اضافی)



https://s3.tradingview.com/snapshots/p/PEbwpXk8.png

۱ـ نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) نداریم

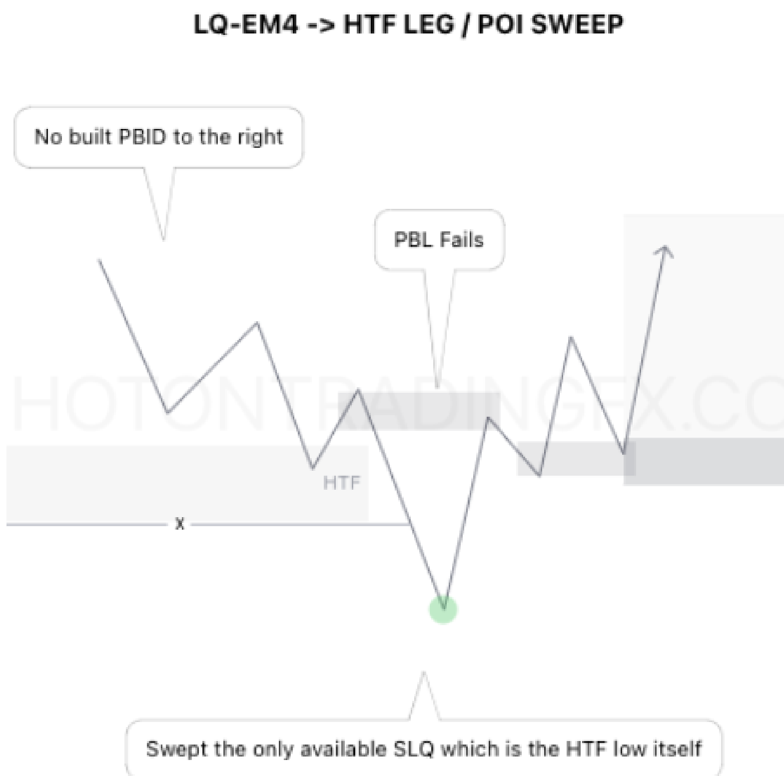
۲ـ نقدینگی راست (نقدینگی پولبک یا pbid) نداریم

۳ـ فلیپ اولیه سویپ ندارد پس شکست آن را نقدینگی تلقی می‌کنیم بـرای منطقـه اکستریم

۴ـ قیمت در برگشت از اکستریم به ناحیه pbl فلیپ واکنش جزیی می‌دهد و فلیـپ جدیدی می‌سازد

۵ـ ورود (ce) در ناحیه فلیپ

مدل **4**:



۱ـ نقدینگی چپ (نقدینگی لگ یا lid) نداریم

۲ـ نقدینگی راست (نقدینگی پولبک یا pbid) نداریم

۳ـ کف اردربلاک اصلی (تایم بالا) سویپ شده یعنی قیمت با سرعت از آن گذشته و برگشته

۴ـ موقع چاک، ناحیه فلیپ تشکیل شده

۵ـ ورود (ce) در ناحیه فلیپ

(این مدل به دلیل ابهام در سویپ / شکست اردربلاک تایم بالا کمی ریسکی تر است و بهتر است معیارهای قوت چاک را در نظر بگیریم)

مدل 5:



۱ـ فلیپ دارای دو کف است که کف دوم کف اول را سویپ کرده (هـر چـه دو کـف مذکور بزرگ‌تر و شفاف تر باشند مدل ورود قوی تر است)

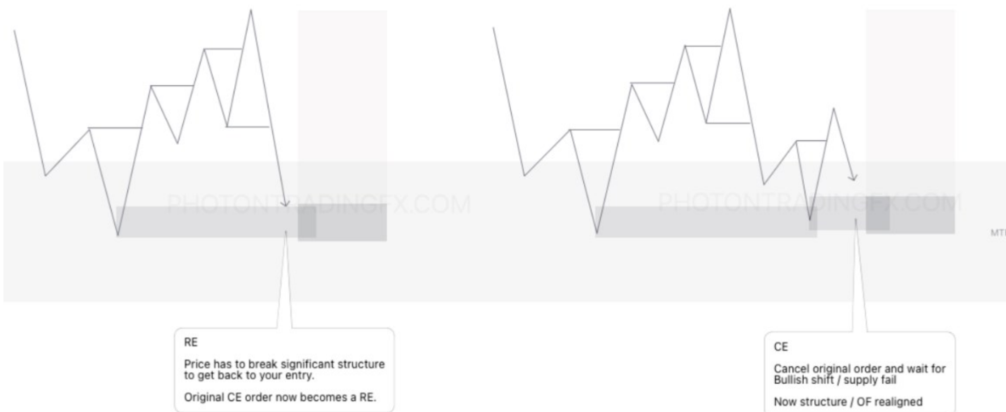
۲ـ ورود در فلیپ

نکته: این مدل هم به دلیل جزیی بودن نـوع نقـدینگی ریسـک دارد پـس در جـایی استفاده ش می‌کنیم که به ناحیه خودمون مطمئن تریم.

٦. کنسل کردن اردر

۱. شکل گیری روند بعد چاک

یعنی مثلا بعد از چاک، ساختار صعودی شکل گرفته و قیمت برای برگشت به منشا چاک باید سقف/کف های متعدد را رد کند. در این صورت اردر کنسل میشود و باید مجددا تایید بدهد:



برای مثال در نمودار زیر اردربلاک ۴ ساعته منشا یک باس را ترسیم کردیم:



سپس در تایم ۱۵ مین به دنبال تایید بودیم. اما بعد از چاک ۱۵ مین یک ساختار صعودی آشکار شکل گرفت. بنابراین بعد از برگشت قیمت دوباره صبر کردیم تا چاک ۱۵ مین شکل بگیرد که این اتفاق طبق نمودار زیر دو بار رخ داده:

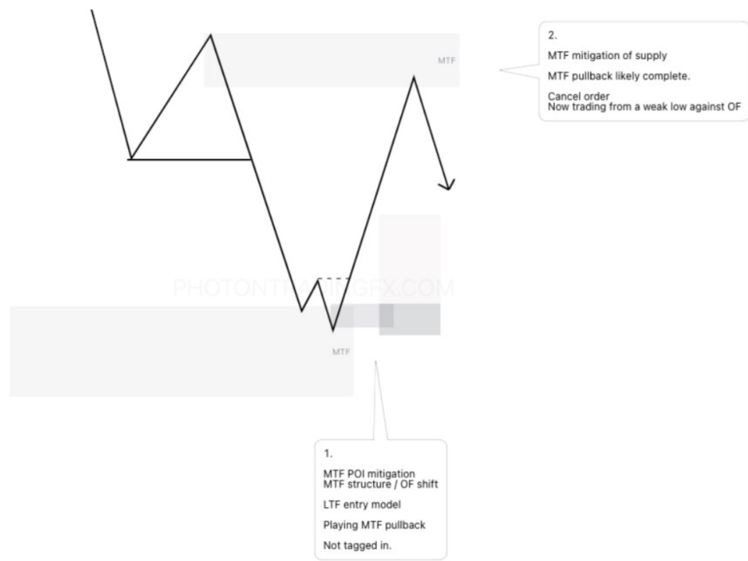


بعد از هر چاک ۱۵ مین به تایم ورود میریم و به این شکل تایید و پوزیشن میگیریم:



۲. رسیدن به عرضه/دیمند مهم بعد چاک

یعنی قیمت قبل از تگ شدن اردر به سف/کف سوینگ ساختار داخلی که تی پی اصلی ماست رسیده



۷. چک لیست و پلن فوتون

فصل ۷.۱ بازبینی شود

فرایند مپ کردن

تایم بالا (داستان قیمت/فاز سوینگ یا پولبک):

- مپ کردن آخرین سوینگ + رنج‌های داخلی + عرضه و تقاضا
- مپ کردن نواحی عرضه و تقاضا
- مپ کردن سویپ زون‌ها و سطوح نقدینگی
- آلارم ست کردن روی نواحی poi مهم

تایم میانی (روند فعلی + اردربلاک‌ها):

- تکرار مراحل تایم بالا
- ست کردن آلارم روی نواحی poi مهم

تایم پایینی (اجرای پوزیشن روی نواحی تایم میانی + ایده‌های معاملاتی)

- انتظار برای میتیگیت شدن نواحی تایم میانی
- مدل ورود
- اجرای قوعد مدیریت ریسک و پوزیشن

تعیین اردربلاک‌ها

شرایط ضروری:

- روش انگالف یا bts/stb (پیوت یا رنج)
- منجر به شکست ساختار (باس/آیباس/چاک) شده باشد

تاییدهای اضافی:

- فلیپ زون
- سویپ زون
- سطوح نقدینگی قوی (ایندوسمنت)
- نواحی استک داخل یک ناحیه تایم بالا
- جایگاه قیمت (دیسکانت/پرمیوم)
- میتیگیت نشده
- زنجیره میتیگیشن (=گپ قبل اردربلاک بجا نمانده باشد)

نکات:

- داستان کلی قیمت چیست؟ (در چه فازی از تایم ساختار و تایم میانی هستیم)
- ادامه روند/اردرفلو یا تنها واکنشی برای یک پولبک؟
- به شکست چه ساختاری منجر شده است؟ (سوینگ/اینترنال/فرکتال)
- آیا موجب ایجاد یک تغییر قابل توجه در مومنتوم شده است؟ (ایمبالانس قابل توجه بین عرضه و تقاضا)
- آیا موجب فلیپ شده است؟ (ناحیه‌ای که فلیپ کرده چقدر قوی است)
- آیا دارای نقدینگی هست؟ (ایندوسمنت)
- آیا در جای مناسبی قرار دارد؟ (دیسکانت/پرمیوم/اکستریم)
- آیا در یک ناحیه تایم بالا استک شده است؟
- آیا بخشی از یک زنجیره میتیگیشن است؟
- میتیگیت نشده است؟ (فرش است یا قبلا موجب واکنش شده)
- اپروچ قیمت به اردربلاک چگونه است؟ (کارکتیو و فشرده/ایمپالسیو و با مومنتوم)
- چه چیزی میتیگیت شده است؟ (قیمت قبلا به یک هدف اصلی خود نرسیده و آن را میتیگیت نکرده باشد)
- کدام سمت کنترل را در دست دارد؟ (عرضه یا تقاضا)

- دلایل احتمال رد شدن قیمت از اردربلاکی که قصد بررسی آن را داریم؟ (کف یا سقف ضعیف بودن/ اردربلاک‌های میتیگیت نشده قبل از آن/ سطوح نقدینگی)
- نقدینگی کجا جمع آوری شده است؟ سطوح نقدینگی کجاست؟ کدام طرف ممکن است ایندوس شود؟

اجرا [پوزیشن] در تایم پایینی

میتیگیت شدن اردربلاک تایم میانی

ورود ریسکی/با تایید

مدل ورود

آیا قبل از ورود باید نقدینگی زده شود

حرکت وی ـ شیپ (مومنتوم موقع خروج)

چاک

ورود در لبه/ ۲۵ درصد/ نیمه/ بدنه اردربلاک؟

استاپ لاس پشت ناحیه ورود + اسپرد

مدیریت پوزیشن

تعیین ریوارد (مثلا ریوارد ثابت ۱۰ برای پوزیشن موافق روند و ریوارد ثابت ۵ برای پوزیشن خلاف روند/ یا ریوارد متغییر بر اساس ساختار ولی با تعیین حداقل ریوارد)

بریک ایون کردن پس از شکست سقف/کف پولبک تایم پایینی یا انتقال استاپ پشت سقف/کف قوی تایم پایینی

ارز: eurusd

مدیریت ریسک

حداکثر سه استاپ در روز

ریسک هر پوزیشن نیم درصد

حداقل فاصله استاپ ۲ پیپ

ترید نکردن ۳۰ دقیقه قبل اخبار مهم

سشن:

دی تریدر: ۱۰:۳۰ تا ۱۳:۳۰ (لندن) و ۱۵:۳۰ تا ۱۹:۳۰ (نیویورک)

سوینگ تریدر: ۱۰:۳۰ تا ۲۰:۳۰

۸. بک‌تست و تریدینگ اج

۹. نکات ریکپ

۱۷ ژانویه ۲۰۲۳

چاک ۴ ساعته

۱۱ دقیقه

تثبیت شکست باس

۲۲

ورود ادامه دهنده

۲۳:۳۰

اردربلاک‌های بدون lid

۲۴

تایم فریمی که باید pbl در آن زده شود

۲۵_۲۵:۲۲

پوزیشن گرفتن مخالف سویپ

۱۱ آگوست ۲۰۲۳

۲_۱:۳۰ دقیقه

بهتر است وضعیت یا الگوی کندلی تایم بالا مغایر با پوزیشن ما نباشد. مثلا وقتی در تایم بالا پین بار در جهت مخالف فشار فروش و سویپ نقدینگی سقف را نشان می‌دهد.

۳:۵۰ دقیقه

روش سویپ اردربلاک در مدل ورود ۴ در رنج‌های ساید

۵ دقیقه

وقتی شکست اولیه باس با سایه بوده باس با کندل‌های بعد وقتی اعتبار دارد کـه بـالای سـایه کندل شکست کلوز کنند. (و دقیقه ۶ ریکپ ۲۴ آگوست)



۱۷:۳۵

وقتی کندل خروج از اوردربلاک با مومنتوم زیاد بالای آن کلوز می‌کند نباید ریفاین کنیم.

۲ سپتامبر ۲۰۲۳ (بریک داون)

دقیقه ۷:۵۰

وقتی در منطقه اکستریم قیمت از اخرین اوردربلاک میت نشده گذشت و می‌خاهیم روی بخشی از اکستریم که اوردربلاک میت نشده ندارد تایید بگیریم باید بیشتر احتیاط کنـیم و صـبر کنـیم اوردرفلو صعودی شود:



٤ سپتامبر ۲۰۲۳

دقیقه ۵: زنجیره متیگیشن



دقیقه ۵:۴۵ و ۶:۱۰: فاز c تایم ۱۵

دقیقه ۶:۳۰: شرایط ورود ریسکی

دقیقه ۹: ساختار داخلی میانی در ۵ مین

دقیقه ۱۲: تفاوت رنج pbl و ریفاین پیوتی ش

دقیقه ۱۳: جاهایی که ریفاین مجاز نیست

دقیقه ۱۴: کنسل نکردن اردر

۸ سپتامبر ۲۰۲۳

دقیقه ۱۲:

دو شرط عدم ورود در فلیپ

دقیقه ۱۹:۴۵:

مواردی که استفاده از ساختار ۵ مین ایمن‌تر است

۳ دقیقه‌ی آخر:

تفاوت ابتدا و انتهای فاز a مخصوصا برای استفاده از ساختار ۵ مین

۱۳ سپتامبر ۲۰۲۳

دقیقه ۱۶:۲۰

فلیپ وقتی اعتبار داره که قیمت ازش خارج بشه و کلوز بده

دقیقه ۲۱ به بعد

شرط ورود: عدم میتیگیت شدن ناحیه عرضه مخالف

اگر دو سناریویی که انتظار داریم طوری باشند که بخشی از حرکت قیمت بین هر دو مشترک باشه ریسک پوزیشن در آن بخش خیلی کمتر هست

۱۹ سپتامبر ۲۰۲۳

دقیقه ۵:۵۰:

قبل از هر ورودی باید یکی از این شرایط محقق شده باشه: میتیگیت شدن یک اردربلاک ۱۵ مین یا زده شدن نقدینگی یک ساختار (کف/سقف) قوی در ۱۵ مین

۲۸ سپتامبر ۲۰۲۳

دقیقه ۱۶ به بعد:

موردی که ترید در فاز دی ریسک کمتری داره (بهمراه چند مثال دیگه از گذشته بازار): ۱. سویپ رنج اسیا ۲. از میان برداشتن همه عرضه‌ها ۳. وی شیپ ۴. فلیپ